华宝兴业行业精选股票型证券投资基金

2013 半年度报告摘要

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:2013年8月24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2013年8月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本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2013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	11,732,421,694.89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(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	886,094,966.45
本期利润	1,674,757,445.50
加权平均基金份额本期利润	0.1366
本期加权平均净值利润率	14.15%
本期基金份额净值增长率	15.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配利润	-2,317,394,578.41
期末可供分配基金份额利润	-0.1975
期末基金资产净值	11,999,832,260.54
期末基金份额净值	1.0228
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013年6月30日)
基金份额累计净值增长率	2.28%

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、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)

3、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。

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	-5.48%	1.75%	-15.57%	1.86%	10.09%	-0.11%
过去三个月	7.91%	1.41%	-11.80%	1.45%	19.71%	-0.04%
过去六个月	15.32%	1.37%	-12.78%	1.50%	28.10%	-0.13%
过去一年	15.88%	1.24%	-10.60%	1.37%	26.48%	-0.13%
过去三年	21.75%	1.21%	-14.14%	1.37%	35.89%	-0.16%
自基金合同生效日起至今	2.28%	1.57%	-46.56%	1.96%	48.84%	-0.39%

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 2013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2007年12月14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(2013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、华宝短融50基金、华宝兴业资源优选基金、华宝添益基金和华宝兴业服务优选基金,所管理的开放式证券投资基金资产净值合计39,612,038,487.56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		
任志强	公司副总经理、投资总监、本基金基金经理	2007年9月7日	2013年2月8日	18年	硕士。1995年3月至1997年3月就职于上海市外高桥保税区开发(控股)公司期货部;1997年4月至1999年2月任职于中国南方证券有限公司,从事证券研究工作。1999年3月至2006年10月在华宝信托投资有限责任公司工作,曾担任研究员、研发中心总经理助理、研发中心总经理、投资管理部总经理、公司总裁助理、公司董事会秘书等职务。2006年10月至2007年8月任华宝证券经纪有限公司董事、副总经理。2007年8月加入华宝兴业基金管理有限公司,任投资总监,2007年9月至2013年2月任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理,2009年6月任命为公司副总经理。
蒋宁	投资副总监、本基金基金经理	2010年7月3日	-	18年	硕士。1995年至1996年任职于上海万国证券公司证券投资总部从事证券研究工作,1996年至2010年3月任职于申银万国证券公司证券投资及金融衍生品总部从事证券投资、研究工作。2010年4月加入华宝兴业基金管理有限公司任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理助理,2010年7月至今任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理,2012年4月起任投资副总监。
沈梦圆	本基金基金经理助理	2009年11月23日	-	5年	硕士,2008年加入华宝兴业基金管理有限公司任研究部分析师,2009年11月至今任华宝兴业行业精选股票基金基金经理助理,2010年12月至2012年9月兼任华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理助理。
楼鸿强	本基金基金经理助理	2012年9月25日	-	4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月起兼任华宝兴业行业精选股票基金基金经理助理。

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。

3、本基金管理人于2013年7月25日发布《华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业行业精选股票型证券投资基金增聘基金经理公告》,增聘范红兵先生为本基金基金经理。

4、本基金管理人于2013年8月22日发布《华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理变更公告》,增聘李卓先生、沈梦圆女士为本基金基金经理,蒋宁女士不再担任本基金的基金经理。

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 公平交易制度的执行情况

2013年上半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。

4.3.2 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

上半年市场整体上是由强转弱的半年,以创业板为代表的中小市值个股走出较强的结构性行情。国内宏观经济数据在1季度部分延续去年底以来的复苏迹象,但未能有效延续,除了前面几个月地产和汽车等少数行业数据尚可之外,大部分中上游行业数据持续低于预期。3月份地产调控新政的出台,以及后期陆续发布的流动性管理规定,货币政策也不再中性偏宽,这增加了后期宏观经济复苏的不确定性。

代表转型方向的部分成长性行业如传媒、医药、电子、环保、高端装备等新兴产业,其发展前景和业绩成长性使得相关个股成为稀缺标的,市场从3月后结构性分化愈加明显。

从1季度末开始,我们对市场的态度从审慎乐观转变为谨慎。1季度我们保持了较高仓位,在精选成长股的同时,加大了周期类个股的波段操作力度,后期逐步降低复苏不明朗周期行业的配置。2季度主要围绕TMT、医药、环保等新兴产业的投资,并在2季度末逐步降低仓位,将配置集中到前景明朗业绩确定的优质成长股龙头上。

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15.32%,业绩比较基准收益率为-12.78%,基金表现领先业绩比较基准28.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后面季度,政府转型之心坚决,除非出现快速迅猛的经济失速,否则大概率不会推出经济刺激政策。因此,不能排除经济增长逐渐回落的可能性,以短期的阵痛换取长期健康的可持续性发展。与此对应,流动性虽然出现边际收紧的迹象,但我们判断在目前宏观经济条件下,流动性仍然会保持相对宽裕。上半年的结构性行情,使得具备成长性的新兴产业相关个股估值偏高,部分缺乏业绩支撑的伪成长股进入验证期。市场机会将继续围绕真正具备成长性的优质成长股上,结构分化行情进一步深化。

相应的,我们将采取相对谨慎的投资策略。在保持中性偏低仓位的前提下,继续精选优质成长股,把握回调过程中的加仓机会,积极布局全年机会。同时,我们将时刻关注宏观经济走势,观察等待周期股可能出现的机会。

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

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。

§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:华宝兴业行业精选股票型证券投资基金

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资产:			
银行存款		1,065,381,053.01	1,211,605,460.95
结算备付金		13,278,078.69	10,876,398.12
存出保证金		3,583,021.48	5,597,121.08
交易性金融资产		9,716,258,132.12	9,238,445,031.83
其中:股票投资		8,808,259,132.12	8,613,600,031.83
基金投资		-	-
债券投资		907,999,000.00	624,845,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		892,402,578.60	296,100,764.15
应收证券清算款		489,238,787.96	501,786,489.74
应收利息		14,797,049.56	15,018,020.21
应收股利		874,104.34	-
应收申购款		830,707.19	30,179,805.53
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		12,196,643,512.95	11,309,609,091.61
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		73,136,294.01	-
应付赎回款		86,239,036.29	5,336,427.91
应付管理人报酬		15,202,959.27	13,255,075.23
应付托管费		2,533,826.53	2,209,179.21
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		18,957,323.84	19,517,388.43
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		741,812.47	1,983,785.89
负债合计		196,811,252.41	42,301,856.67
所有者权益:			
实收基金		11,732,421,694.89	12,703,673,009.50
未分配利润		267,410,565.65	-1,436,365,774.56
所有者权益合计		11,999,832,260.54	11,267,307,234.94
负债和所有者权益总计		12,196,643,512.95	11,309,609,091.61

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值1.0228元,基金份额总额11,732,421,694.89份。

6.2 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:2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入		1,808,309,755.62	1,323,748,318.71
1.利息收入		19,912,616.18	11,663,724.17
其中:存款利息收入		5,522,640.31	5,263,366.67
债券利息收入		9,389,809.60	2,854,520.54
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,000,166.27	3,545,836.96
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		999,017,068.23	-32,194,794.88
其中:股票投资收益		950,680,204.15	-85,405,326.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-186,215.15	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		48,523,079.23	53,210,531.54
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		788,662,479.05	1,343,474,642.05
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		717,592.16	804,747.37
减:二、费用		133,552,310.12	114,509,310.03
1.管理人报酬		87,975,158.15	78,561,882.36
2.托管费		14,662,526.35	13,093,647.11
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		30,655,627.67	22,598,796.55
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		258,997.95	254,984.01
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		1,674,757,445.50	1,209,239,008.68
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		1,674,757,445.50	1,209,239,008.68

6.3 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:2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	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)	-	1,674,757,445.50	1,674,757,445.50
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)	-971,251,314.61	29,018,894.71	-942,232,419.90
其中:1.基金申购款	512,865,945.64	-11,456,213.55	501,409,732.09
2.基金赎回款	-1,484,117,260.25	40,475,108.26	-1,443,642,151.99
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	11,732,421,694.89	267,410,565.65	11,999,832,260.54

项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	13,076,037,899.59	-2,782,107,854.18	10,293,930,045.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,209,239,008.68	1,209,239,008.68
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)	-766,276,144.74	128,142,003.54	-638,134,141.20
其中:1.基金申购款	347,019,524.62	-40,703,464.98	306,316,059.64
2.基金赎回款	-1,113,295,669.36	168,845,468.52	-944,450,200.84
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)	12,309,761,754.85	-1,444,726,841.96	10,865,034,912.89

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2013年8月24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[2010]5号《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2013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2013年6月30日的财务状况以及2013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[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,按财政部、国家税务总局、中国证监会于2012年11月16日联合发布财税[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》(以下简称"通知"),要求个人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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得,按照本通知的规定计征个人所得税。通知自2013年1月1日起施行。

(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

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30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	290,482,237.25	1.47%	635,526,114.75	4.25%

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告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。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30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	264,451.72	1.49%	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30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	540,195.80	4.32%	-	-

注: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。

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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	87,975,158.15	78,561,882.36
其中:支付销售机构的客户维护费	15,219,852.25	14,410,085.60

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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	14,662,526.35	13,093,647.11

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 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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
期初持有的基金份额	1,879,090.65	1,879,090.65
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	267,765.66	-
期末持有的基金份额	1,611,324.99	1,879,090.65
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.01%	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。

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

本基金本报告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。

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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	1,065,381,053.01	5,341,763.45	160,622,563.18	5,137,554.97

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内与上年度可比期间无参与关联方承销证券的情况。

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(2013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
002313	日海通讯	2012年7月17日	2013年7月18日	非公开发行流通受限	20.00	16.42	2,000,000	40,000,000.00	32,840,000.00	2013年5月10日,每10股派息3.0元(含税)
002313	日海通讯	-	2013年7月18日	非公开发行流通受限	-	16.42	600,000	-	9,852,000.00	2013年5月10日每10股转增3.0股

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
300027	华谊兄弟	2013年6月5日	重大事项停牌	28.55	2013年7月24日	31.41	8,886,866	212,504,324.00	253,720,024.30	-
300326	凯利泰	2013年6月17日	重大事项停牌	35.55	2013年7月29日	39.11	954,950	31,130,481.14	33,948,472.50	-
601989	中国重工	2013年5月17日	重大事项停牌	4.52	尚未复牌	尚未复牌	429,016	2,300,473.53	1,939,152.32	-
600598	北大荒	2013年5月27日	重大事项停牌	8.35	2013年7月19日	8.35	54,953	456,489.93	458,857.55	-
601918	国投新集	2013年5月16日	重大事项停牌	7.55	尚未复牌	尚未复牌	53,009	557,333.37	400,217.95	-
600547	山东黄金	2013年4月3日	重大事项停牌	24.30	2013年7月1日	28.77	67,652	2,460,660.78	1,643,943.60	-
000999	华润三九	2013年6月3日	重大事项停牌	26.55	2013年8月19日	26.51	18,309	448,862.29	486,103.95	-
300133	华策影视	2013年5月28日	重大事项停牌	23.88	2013年7月30日	26.87	9,363,952	162,108,359.32	223,611,173.76	-

注:本基金截至2013年6月30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。

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

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

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购,因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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

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)。

于2013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 8,249,359,186.19元,属于第二层级的余额为1,466,898,945.93元,无属于第三层级的余额(2012年12月31日:第一层级8,269,072,479.19元,第二层级969,372,552.64元,无第三层级)。

对于持有的重大事项停牌股票,本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级,并于复牌后从第二层级转回第一层级(2012年度:同)。

(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	8,808,259,132.12	72.22
	其中:股票	8,808,259,132.12	72.22
2	固定收益投资	907,999,000.00	7.44
	其中:债券	907,999,000.00	7.44
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	892,402,578.60	7.32
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	1,078,659,131.70	8.84
6	其他各项资产	509,323,670.53	4.18
7	合计	12,196,643,512.95	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	1,436,537.36	0.01
B	采矿业	96,608,884.68	0.81
C	制造业	3,587,919,869.20	29.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	49,253,346.55	0.41
E	建筑业	1,397,521,763.41	11.65
F	批发和零售业	37,182,332.02	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	4,771,028.46	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	338,322,698.70	2.82
J	金融业	66,251,851.48	0.55
K	房地产业	921,837,562.53	7.68
L	租赁和商务服务业	628,359,893.51	5.24
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	782,786,748.84	6.52
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,200,000.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	477,757,712.04	3.98
S	综合	411,048,903.34	3.43
	合计	8,808,259,132.12	73.40

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	300070	碧水源	20,739,217	781,453,696.56	6.51
2	002375	亚厦股份	18,152,213	559,088,160.40	4.66
3	002038	双鹭药业	8,213,147	481,290,414.20	4.01
4	300058	蓝色光标	10,797,733	450,265,466.10	3.75
5	600256	广汇能源	31,647,285	410,148,813.60	3.42
6	000002	万 科A	35,843,771	353,061,144.35	2.94
7	002450	康得新	12,000,000	335,760,000.00	2.80
8	600887	伊利股份	9,577,919	299,597,306.32	2.50
9	600518	康美药业	14,763,528	283,902,643.44	2.37
10	300027	华谊兄弟	8,886,866	253,720,024.30	2.11

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

7.4.9 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	000024	招商地产	407,315,264.46	3.62
2	002038	双鹭药业	347,769,506.27	3.09
3	600519	贵州茅台	255,032,390.93	2.26
4	000961	中南建设	238,227,667.55	2.11
5	002244	滨江集团	222,695,681.94	1.98
6	300273	和佳股份	216,346,330.26	1.92
7	300027	华谊兄弟	212,504,324.00	1.89
8	601166	兴业银行	211,301,653.46	1.88
9	601169	北京银行	206,296,071.53	1.83
10	600383	金地集团	203,431,696.09	1.81
11	002400	省广股份	203,096,313.90	1.80
12	600376	首开股份	190,398,394.22	1.69
13	000002	万 科A	184,948,597.79	1.64
14	002051	中工国际	183,054,017.44	1.62
15	300133	华策影视	162,108,359.32	1.44
16	300026	红日药业	152,292,197.46	1.35
17	300147	香雪制药	149,535,858.90	1.33
18	600048	保利地产	142,771,450.90	1.27
19	000001	平安银行	139,557,396.90	1.24
20	300115	长盈精密	136,095,437.12	1.21

注:买入金额不包括相关交易费用。

7.4.10 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	002081	金 螳 螂	558,086,455.50	4.95
2	002304	洋河股份	469,993,995.50	4.17
3	002450	康得新	379,451,987.88	3.37
4	600519	贵州茅台	370,478,163.02	3.29
5	002241	歌尔声学	340,019,335.28	3.02
6	002236	大华股份	282,842,625.50	2.51
7	600557	康缘药业	268,914,209.99	2.39
8	000024	招商地产	265,576,309.71	2.36
9	002415	海康威视	232,024,923.39	2.06
10	002310	东方园林	210,894,837.54	1.87
11	601166	兴业银行	195,375,306.22	1.73
12	601169	北京银行	190,222,255.55	1.69
13	600383	金地集团	185,315,751.60	1.64
14	002375	亚厦股份	182,127,868.97	1.62
15	601888	中国国旅	172,024,112.91	1.53
16	600546	山煤国际	163,010,768.20	1.45
17	600518	康美药业	151,043,327.19	1.34
18	600315	上海家化	137,098,159.77	1.22
19	600048	保利地产	128,379,703.27	1.14
20	000001	平安银行	126,994,996.80	1.13

注:卖出金额不包括相关交易费用。

7.4.11 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	9,083,322,062.65
卖出股票收入(成交)总额	10,629,457,135.30

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	358,186,000.00	2.98
	其中:政策性金融债	358,186,000.00	2.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	549,813,000.00	4.58
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	907,999,000.00	7.57

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

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	130218	13国开18	2,500,000	248,575,000.00	2.07
2	130201	13国开01	500,000	49,725,000.00	0.41
3	041356011	13统众CP001	500,000	49,590,000.00	0.41
4	041359026	13海淀国资CP001	500,000	49,565,000.00	0.41
5	041259037	12京热力CP001	400,000	40,292,000.00	0.34

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 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。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1

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。

7.10.2

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。

7.10.3 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	3,583,021.48
2	应收证券清算款	489,238,787.96
3	应收股利	874,104.34
4	应收利息	14,797,049.56
5	应收申购款	830,707.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	509,323,670.53

7.10.4 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。

7.10.5 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	300027	华谊兄弟	253,720,024.30	2.11	重大事项停牌

§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
481,390	24,371.97	972,382,487.74	8.29%	10,760,039,207.15	91.71%

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	1,495,208.19	0.0127%

注:

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

50万份至100万份(含)

(二)该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间:

10万份至50万份(含)

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

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2007年6月14日)基金份额总额	9,998,540,080.34
本报告期期初基金份额总额	12,703,673,009.50
本报告期基金总申购份额	512,865,945.64
减:本报告期基金总赎回份额	1,484,117,260.25
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	11,732,421,694.89

注:总申购份额含转换入份额;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)2013年5月28日,基金管理人发布高级管理人员变更公告,常务副总经理谢文杰因工作变动,自2013年5月24日起不再担任常务副总经理的职务。

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

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

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

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

截至报告披露日,调查仍在进行中,尚无任何结论。

2、本报告期内,基金管理人的高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

3、本报告期内,基金托管人及其高级管理人员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	
申银万国	1	2,673,946,836.00	13.56%	2,401,247.44	13.50%	-
中信证券	1	2,583,613,829.32	13.11%	2,322,846.67	13.06%	-
东方证券	1	2,358,001,918.46	11.96%	2,115,096.89	11.89%	-
日信证券	1	1,805,386,461.20	9.16%	1,615,586.16	9.08%	-
广州证券	1	1,536,407,040.02	7.79%	1,398,745.41	7.86%	-
中投证券	1	1,284,829,100.64	6.52%	1,169,714.42	6.58%	-
民生证券	1	969,082,379.57	4.92%	882,250.64	4.96%	-
银河证券	1	880,494,580.33	4.47%	801,602.24	4.51%	-
安信证券	1	864,098,385.61	4.38%	786,673.34	4.42%	-
中银国际	1	808,155,023.23	4.10%	724,302.49	4.07%	-
国信证券	1	658,181,412.01	3.34%	585,232.74	3.29%	-
华创证券	1	655,715,704.58	3.33%	596,964.15	3.36%	-
海通证券	1	472,998,821.75	2.40%	430,617.93	2.42%	-
宏源证券	1	429,260,095.40	2.18%	385,569.69	2.17%	-
广发证券	1	397,710,910.31	2.02%	362,076.55	2.04%	-
兴业证券	1	363,783,391.98	1.85%	331,188.27	1.86%	-
华宝证券	1	290,482,237.25	1.47%	264,451.72	1.49%	-
东北证券	1	249,747,300.47	1.27%	221,001.69	1.24%	-
平安证券	1	228,916,950.20	1.16%	208,407.00	1.17%	-
国金证券	1	125,616,304.82	0.64%	114,360.59	0.64%	-
华泰联合	1	48,201,648.77	0.24%	42,653.70	0.24%	-
国泰君安	1	27,841,762.91	0.14%	25,346.98	0.14%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
财富里昂	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
中金国际	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

注: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:财富里昂。停止租用席位:西藏证券,金元证券。

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
申银万国	10,010.12	0.01%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	500,000,000.00	22.29%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	7,946,946.80	9.57%	1,143,200,000.00	50.96%	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国信证券	75,094,192.10	90.42%	-	-	-	-
华创证券	-	-	600,000,000.00	26.75%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
财富里昂	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

华宝兴业基金管理有限公司

2013年8月24日