华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

【2013】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:2014年3月31日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料已经审计,安永华明会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2013年01月01日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业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	319,417,631.23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	唐州徽
	联系电话	021-38505888	95566
	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	本基金年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	42,958,622.49	-28,811,573.30	-265,522,218.77
本期利润	50,291,085.78	72,093,484.73	-400,593,487.31
加权平均基金份额本期利润	0.1334	0.1425	-0.5436
本期加权平均净值利润率	9.39%	10.95%	-35.77%
本期基金份额净值增长率	9.65%	7.40%	-30.49%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配利润	76,786,149.59	66,281,883.31	114,300,561.12
期末可供分配基金份额利润	0.2404	0.1286	0.1872
期末基金资产净值	467,925,477.18	688,572,665.84	759,475,935.86
期末基金份额净值	1.4649	1.3360	1.2439
3.1.3 累计期末指标	2013年末	2012年末	2011年末
基金份额累计净值增长率	53.09%	39.62%	30.00%

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	-5.48%	1.23%	-2.45%	0.90%	-3.03%	0.33%
过去六个月	10.69%	1.37%	5.06%	1.03%	5.63%	0.34%
过去一年	9.65%	1.39%	-5.30%	1.11%	14.95%	0.28%
过去三年	-18.13%	1.24%	-18.57%	1.06%	0.44%	0.18%
过去五年	51.61%	1.39%	28.47%	1.24%	23.14%	0.15%
自基金合同生效日起至今	53.09%	1.36%	14.67%	1.32%	38.42%	0.04%

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%。

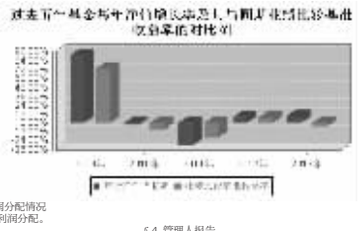
2.净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的,包括所有交易日以及季末最后一自然日(如非交易日)。

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2013年12月31日)

注:按照基金合同的约定,自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合,截至2009年4月7日,本基金已达到基金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(2013年12月31日),所管理的开放式证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、稳领收益基金、中证100 基金、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60基金、华宝兴业资源优选基金、华宝添益基金和华宝兴业服务优选基金,所管理的开放式证券投资基金资产净值合计42,053,592,319.43元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
范红兵	本基金基金经理、华宝兴业医药生物基金经理、华宝兴业行业精选基金基金经理	2010年7月28日	-	13年	硕士,曾在南方证券股份有限公司中新苏州工业园创业投资有限公司和平安证券股份有限公司从事证券研究、风险投资工作,于2007年7月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后任高级分析师、基金经理助理。2009年2月至2010年9月任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理,2010年7月起任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理,2012年2月起兼任华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金基金经理,2013年7月起兼任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理。
王智慧	研究部总经理、本基金基金经理、华宝兴业医药生物基金经理、华宝兴业多策略基金基金经理	2012年1月19日	-	12年	管理学博士,曾在中国国际金融有限公司、上海申银万国证券研究所、浙江龙盛集团、国元证券有限公司从事投资研究工作。2009年8月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后任研究部副总经理、投资经理、基金经理助理的职务。现任研究部总经理,2012年1月至今任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金的基金经理,2012年2月起兼任华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金基金经理,2013年2月起兼任华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金经理。
夏林锋	本基金基金经理助理	2012年10月8日	-	3年	硕士,2010年加入华宝兴业基金管理有限公司任研究员,2012年10月起兼任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金的基金经理助理。

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。

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、投权、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日报及组合间反向交易、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同一债券估价收益率之间的差异,同购利率与当日市场平均利率之间的差异,对上述监督内容存在异常的情况要求投资组合经理进行合理性解释。

4)对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程的公允性进行监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

2013年全年基金管理人严格遵守公司内部制定的公平交易制度和控制方法,确保了所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。公司内部制定的公平交易制度涉及的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

同时,基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,分析了公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异;并采集了连续四个季度期间内,不同时间窗下(1日、3日、5日)同向交易的价差,对其进行95%置信区间下的假设检验分析,同时结合组合的成交金额,并参考市场成交量等因素综合判断是否存在不公平交易、利益输送的可能性。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2013年,政策导向日趋明确、流动性从紧趋势明显,国内经济L型走势逐步成为一致预期,海外市场平稳复苏,A股市场结构分化显著。政策方面,改革转型的认识日趋一致,从十八大之后习总书记首次视察选择深圳,到三中全会聚焦全面深化改革,新一届领导集体改革决心的意图明确,尤其三中全会《决议》全面阐述了未来5-10年的改革路线图,涵盖经济、政治、文化、社会、生态文明、国防、党建各个方面,涉及60项改革任务,300多条改革事项,对改革红利的憧憬市场中长期信心恢复明显。流动性方面,影子银行风险陆续兑现,年初银监会4号文、10号文、年末国办107号文与指向影子银行相关业务,尤其年中爆发的银行间“钱荒”、下半年国债收益率飙升让资本市场记忆犹新,同时从刚出台的全年数据来看,2013全年社会融资总量17.3万亿,同比增长67%,新增信贷8.9万亿,同比增长9.2%,年度增幅均较有限,整体流动性从紧态势明显。海外方面,在经济方面,市场经历了L型走势确认的预期调整,年初随着2012年四季度GDP同比增速对经济底部的确认,PMI、工业增加值、发用电量等数据的走强,市场预期经济将强势复苏,但2月份之后旺季不旺迹象明显,乐观预期逐步证伪,同时市场对中长期经济增长动能减弱、整体流动性从紧的预期趋于明朗,经济L型走势的判断渐成一致预期,而后续GDP季度同比也呈小幅回落展违走势。海外市场方面,美国经济持续复苏,美联储明确QE退出基本原则及时间表,黄金持续下跌,资金从新兴市场回流美国的态势较为明显;欧洲经济复苏进度虽然较为迟缓但趋势明显,日元持续贬值,但日本连续多月录得贸易赤字,同时国债收益率有所抬升,安倍经济学面临一定挑战。

在此背景下,A股市场自2012年底的反弹行情未能持续,在3.4月旺季不旺之后出现回调,并因6月底银行间市场“钱荒”影响创出新低,且在整个下半年维持低位振荡;不过成长与价值之间的分化相当剧烈,市场逐步确认政府调结构优于稳增长的态度,并从估值角度予以强化,代表未来增长方向的成长股被赋予更高的期待与估值,创业板指数屡创新高。本基金在2013年全年均维持中性略高仓位,并持续进行结构调整,适度降仓金融、地产、机械、化工等板块,适度增仓TMT、医药、环保、大众食品等板块,适度参与4G、新能源汽车等板块,同时持续优化精选相关个股,持续坚持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9.65%,同期业绩比较基准收益率为-5.30%,基金表现领先业绩比较基准14.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,A股整体估值仍处于中长期底部区域,随着各项改革措施逐步落实,A股市场有望成为融资投资兼备、促进经济转型升级的重要载体,作为市场参与者,我们保持一份乐观;展望2014年,我们也需关注长期改革深化与中期景气压力之间青黄不接的风险,毕竟从政策预期、流动性走势、经济态势、海外流动性等角度来看,2014年经济形势及企业盈利难言乐观,因此在甄选投资机会时,我们维持一份审慎。

政策方面,三中全会《决议》绘出路线图之后,后续还需跟踪相关措施的具体落实,同时从年度经济工作会议“稳增长、调结构、促改革”的定调来看,2014年财政政策、货币政策大幅放松的可能性不高;流动性方面,规范监管的措施已经逐步落地,但其影响还将持续,且高企的银行间利率及国债利率可能传导至实体经济,信用风险如何演化还需密切关注,不过目前判断不至于爆发系统性风险;国内经济增长方面,中长期制约因素还未实质性改善,短期经济增长动能有所减弱,叠加流动性从紧约束,预估2014年维持平稳的概率较大;而以美国为首的发达经济体复苏态势明显,预期将陆续进入流动性收缩通道,其自身经济增长压力可能不大,但新兴市场资金流出压力可能凸显,预期也将对我国外汇流入形势产生一定冲击。

综上判断,预估2014年将是中期的转折之年,一方面需关注长期信心的修复,另一方面也需关注中期风险的兑现。A股市场可能仍将维持震荡态势,结构方面仍需关注代表未来增长转型方向的优质成长股、消费股,风险方面需关注IPO进程是否过快、信用风险是否爆发等。2014年,本基金将继续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比较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。加强对基金运作的严密操作风险控制、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,高化正确立的流程,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,并根据内部控制要员会和监察稽核部门提出的意见、建议调整或改善了前、中、后台的业务流程。

(三)有重点地全面开展内部审计稽核工作。2013年,监察稽核部门按计划对公司营运、投资、市场部门进行了业务审计,加强了防控内幕交易等行为的稽核力度;并与相关部门进行沟通,形成后续跟踪和业务上相互促进的良性循环,不断提高工作质量。

在今后的工作中,本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念,完善内控制度,提高工作水平,努力防范和控制各种风险,保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人在报告期内对旗下基金估值过程中,公司内部参与估值流程的各方职责分工如下:

(一)基金会计:根据《基金会计核算业务指引》对基金日常交易进行记账核算,并对基金投资品种进行估值。

(二)量化投资部:对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况下,根据估值委员会对存续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。

§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、基金份额申购赎回的价格、利息的计算和支付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:2013年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资产:			
银行存款		26,737,668.73	59,168,474.80
结算备付金		1,104,071.88	1,756,026.60
存出保证金		151,144.16	47,034.80
交易性金融资产		407,348,169.54	635,963,427.50
其中:股票投资		407,348,169.54	635,963,427.50
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		11,687.35	19,230.08
应收股利		-	-
应收申购款		51,150.14	106,584.23
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		473,939,013.39	697,060,778.01
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,105,218.13	3,682,120.33
应付赎回款		998,460.24	1,303,326.39
应付管理人报酬		602,722.68	801,243.22
应付托管费		100,453.77	133,540.55
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		876,153.99	2,236,994.16
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		330,527.40	330,887.52
负债合计		6,013,536.21	8,488,112.17
所有者权益:			
实收基金		319,417,631.23	515,411,649.54
未分配利润		148,507,845.95	173,161,016.30
所有者权益合计		467,925,477.18	688,572,665.84
负债和所有者权益总计		473,939,013.39	697,060,778.01

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.4649元,基金份额总额319,417,631.23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:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入		66,206,729.59	90,720,511.32
1.利息收入		646,945.97	1,025,927.38
其中:存款利息收入		560,560.56	739,197.35
债券利息收入		778.31	48,162.67
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		85,607.10	238,567.36
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		57,885,387.36	-11,555,745.28
其中:股票投资收益		53,300,194.08	-18,669,492.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益		353,569.24	14,325.52
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		4,231,624.04	7,099,421.66
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		7,332,463.29	100,905,058.03
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		341,932.97	345,271.19
减:二、费用		15,915,643.81	18,627,026.59
1.管理人报酬		8,077,816.11	9,938,823.18
2.托管费		1,346,302.58	1,656,470.55
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		6,129,339.21	6,669,329.06
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		362,185.91	362,403.80
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		50,291,085.78	72,093,484.73
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		50,291,085.78	72,093,484.73

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:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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(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(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

项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	610,576,706.78	148,899,229.08	759,475,935.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	72,093,484.73	72,093,484.73
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-95,165,057.24	-47,831,697.51	-142,996,754.75
其中:1.基金申购款	135,916,223.62	35,890,909.47	171,807,133.09
2.基金赎回款	-231,081,280.86	-83,722,606.98	-314,803,887.84
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)	515,411,649.54	173,161,016.30	688,572,665.84

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:

黄小康 张丽 张幸毅

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 基金本体情况

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]156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2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。

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或合同权利终止,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款项的一部分确认为权证投资成本,按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本;

上市后,上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算;

(5)回购协议

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

1)股票投资

(1)上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的