# 华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金

## 【2014】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:2014年8月29日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2014年01月01日起至06月30日止。

1.2

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金 |
| 基金简称 | 华宝兴业新兴产业股票 |
| 基金主代码 | 240017 |
| 交易代码 | 240017 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年12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 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,655,050,241.14份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 分享新兴产业所带来的投资机会,力争在长期内为基金份额持有人获取超额回报。 |
| 投资策略 | 本基金采取积极的大类资产配置策略,通过宏观策略研究,对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪,通过对新兴产业相关行业的辨识、精选以及对新兴产业相关股票的深入分析,挖掘该类型企业的投资价值,分享新兴产业发展所带来的较高回报。本基金通过采取自上而下的方法确定投资组合久期,结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。 |
| 业绩比较基准 | 75%中证新兴产业指数+25%上证国债指数。 |
| 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(2014年1月1日 - 2014年6月30日) |
| 本期已实现收益 | 212,448,260.76 |
| 本期利润 | 124,860,644.06 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0714 |
| 本期加权平均净值利润率 | 4.68% |
| 本期基金份额净值增长率 | 5.68% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2014年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 604,651,542.65 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.3653 |
| 期末基金资产净值 | 2,560,027,718.33 |
| 期末基金份额净值 | 1.5468 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2014年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 54.68% |

注:1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、净值相关数据计算中涉及天数的,包括所有交易日以及季末最后一自然日(如非交易日)。

4、期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 4.74% | 1.15% | 2.53% | 0.69% | 2.21% | 0.46% |
| 过去三个月 | 7.25% | 1.28% | 3.41% | 0.76% | 3.84% | 0.52% |
| 过去六个月 | 5.68% | 1.47% | 0.68% | 0.92% | 5.00% | 0.55% |
| 过去一年 | 27.25% | 1.60% | 13.91% | 1.04% | 13.34% | 0.56% |
| 过去三年 | 76.96% | 1.51% | -4.02% | 1.11% | 80.98% | 0.40% |
| 自基金合同生效日起至今 | 54.68% | 1.43% | -11.72% | 1.12% | 66.40% | 0.31% |

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:75%中证新兴产业指数+25%上证国债指数。

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

(2010年12月7日至2014年6月30日)

注:按照基金合同的约定,自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合,截至2011年6月6日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是2003 年3 月7 日正式成立的合资基金管理公司,截至本报告期末(2014年6月30日),所管理的开放式证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、增强收益基金、中证100 基金、上证180价值ETF、上证180价值ETF 联接基金、新兴产业基金、成熟市场动量优选基金、可转债基金、上证180成长ETF、上证180成长ETF联接基金、华宝油气基金、华宝兴业医药生物基金、华宝兴业活期通货币市场基金(原华宝兴业短融50基金转型)、华宝兴业资源优选基金、华宝添益基金、华宝兴业服务优选基金、华宝兴业创新优选基金以及华宝兴业生态中国基金,所管理的开放式证券投资基金资产净值合计56,168,945,206.12元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 郭鹏飞 | 投资副总监、国内投资部总经理、本基金基金经理、华宝兴业宝康灵活配置基金经理 | 2010年12月7日 | - | 10年 | 博士,拥有CFA资格。2004年2月加入华宝兴业基金管理有限公司任研究部行业分析师,2007年9月任公司研究部副总经理,2009年3月至2010年6月任公司研究部总经理,2010年6月至今任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理,2010年12月起兼任华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金经理,2012年4月起任国内投资部总经理,2014年6月任投资副总监。 |
| 朱亮 | 本基金基金经理、华宝兴业先进成长股票基金经理、华宝兴业创新股票基金经理 | 2013年7月25日 | - | 8年 | 硕士,曾在信多科技(中国)有限公司任产品总监,国金证券股份有限公司任研究员,2008年7月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后任研究部高级分析师,国内投资部基金经理助理,2012年6月至今任华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金经理,2013年7月起兼任华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金经理,2014年5月兼任华宝兴业创新优选股票型证券投资基金基金经理。 |
| 陈乐华 | 本基金基金经理助理、华宝兴业创新股票基金经理助理 | 2011年11月15日 | 2014年6月18日 | 7年 | 硕士,曾在中信建投证券有限责任公司从事行业研究工作。2010年5月加入华宝兴业基金管理有限公司任行业分析师,2011年11月至2014年6月任华宝兴业新兴产业股票基金经理助理,2014年6月任华宝兴业创新优选股票型证券投资基金基金经理助理。 |
| 易镜明 | 本基金基金经理助理、华宝兴业先进成长股票基金经理助理 | 2014年6月18日 | - | 8年 | 博士,曾在国泰君安证券、中海基金从事行业研究工作。2012年11月加入华宝兴业基金管理有限公司任高级分析师,2014年6月任华宝兴业先进成长股票型证券投资基金、华宝兴业新兴产业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、《华宝兴业新兴产业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

本报告期内,基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制,确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时,基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求,分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差;分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%。

本报告期内,本基金未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年上半年,市场整体表现为下跌,但以创业板和中小板为代表的成长股表现要明显好于以上证指数和沪深300为代表的大盘蓝筹股。在此期间,上证综指和沪深300指数分别下跌3.2%和7.08%;深成指和中小板指数分别下跌9.59%、3.72%,而创业板却走出了独立的上涨行情,指数上涨幅度达到7.69%。分行业来看,计算机、通信、电子和休闲服务的行业指数涨幅超过10%;采掘、农林牧渔等行业指数表现较差,跌幅超过10%。成长股内部也出现很大分化,前几年的大牛股如歌尔、大华、富瑞出现大幅下跌,而以智慧城市、医疗服务、电动车等代表的新成长股相对强势,股价屡创新高。我们认为,这其中细分行业景气度的变化是股价表现的内因,而整个市场存量资金的博弈,放大了细分板块间的股价表现。

报告期间,我们适当降低了仓位,并增持了一些业绩超预期的高成长性个股。同时,我们也减持了一些业绩不达预期的个股。

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5.68%,同期业绩比较基准收益率为0.68%,基金表现领先于基准5.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年,伴随着房地产投资增速的不断下滑,政府又开始从信贷和投资方面开始一些微刺激动作,以期对冲房地产投资增速下滑对经济的负面影响。展望三季度,我们预计经济有可能在政策的再次干预下出现企稳,这将有利于市场短期企稳。但是,从目前来看,中国经济仍然处在增速下滑的通道,A股,尤其是与宏观经济息息相关的大盘蓝筹股仍难以有较好的表现,而成长股也需要时间来消化其较高的估值。但从更长远一点来看,我们仍然对未来几年的股市表现有很大信心,主要是我们处在以电动车、页岩气、智能手机等代表的席卷全球的技术创新、以移动互联网代表的商业模式创新,以及中国深化改革带来的制度创新的三曲共奏中,这必将对股市有着长期积极的影响。

我们仍坚持以成长股为核心配置的策略,紧密跟踪各行业景气度变化,精选优秀的公司,坚定长期持有,分享这些公司中长期业绩快速增长带来的丰厚回报。感谢基金持有人一直以来对我们的支持,我们将继续勤勉尽责,努力为持有人创造好的回报。

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

本基金本报告期末未进行利润分配,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:华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2014年6月30日 | 上年度末 2013年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资 产: | | | |
| 银行存款 | | 437,367,416.49 | 217,736,550.81 |
| 结算备付金 | | 785,462.06 | 2,650,655.56 |
| 存出保证金 | | 703,302.30 | 744,490.14 |
| 交易性金融资产 | | 2,057,207,209.75 | 2,277,031,699.72 |
| 其中:股票投资 | | 2,057,207,209.75 | 2,177,041,699.72 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | 99,990,000.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | - | - |
| 应收证券清算款 | | 100,014,712.85 | - |
| 应收利息 | | 75,192.93 | 3,291,394.08 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 1,834,184.82 | 3,750,807.08 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 2,597,987,481.20 | 2,505,205,597.39 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2014年6月30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 | | 1,883,260.99 | 10,061,289.69 |
| 应付赎回款 | | 25,673,006.32 | 19,720,395.91 |
| 应付管理人报酬 | | 3,067,271.80 | 3,059,813.96 |
| 应付托管费 | | 511,211.99 | 509,968.98 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | | 6,333,643.25 | 4,499,763.74 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 491,368.52 | 433,871.41 |
| 负债合计 | | 37,959,762.87 | 38,285,103.69 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | | 1,655,050,241.14 | 1,685,504,075.61 |
| 未分配利润 | | 904,977,477.19 | 781,416,418.09 |
| 所有者权益合计 | | 2,560,027,718.33 | 2,466,920,493.70 |
| 负债和所有者权益总计 | | 2,597,987,481.20 | 2,505,205,597.39 |

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.5468元,基金份额总额1,655,050,241.14份。

6.2 利润表

会计主体:华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 154,894,456.48 | 801,397,311.40 |
| 1.利息收入 | | 1,455,730.51 | 2,782,585.67 |
| 其中:存款利息收入 | | 1,346,477.67 | 1,339,122.04 |
| 债券利息收入 | | 81,863.01 | 1,064,219.18 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 27,389.83 | 379,244.45 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | | 237,692,594.91 | 508,834,238.54 |
| 其中:股票投资收益 | | 229,853,205.22 | 498,388,337.02 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | 16,700.00 | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 股利收益 | | 7,822,689.69 | 10,445,901.52 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | | -87,587,616.70 | 283,975,697.31 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | | 3,333,747.76 | 5,804,789.88 |
| 减:二、费用 | | 30,033,812.42 | 33,197,658.52 |
| 1.管理人报酬 | | 19,886,053.64 | 21,447,404.46 |
| 2.托管费 | | 3,314,342.29 | 3,574,567.48 |
| 3.销售服务费 | | - | - |
| 4.交易费用 | | 6,614,497.88 | 7,965,168.35 |
| 5.利息支出 | | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6.其他费用 | | 218,918.61 | 210,518.23 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | | 124,860,644.06 | 768,199,652.88 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | | 124,860,644.06 | 768,199,652.88 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 1,685,504,075.61 | 781,416,418.09 | 2,466,920,493.70 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 124,860,644.06 | 124,860,644.06 |
| 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) | -30,453,834.47 | -1,299,584.96 | -31,753,419.43 |
| 其中:1.基金申购款 | 1,192,968,825.73 | 659,740,860.77 | 1,852,709,686.50 |
| 2.基金赎回款 | -1,223,422,660.20 | -661,040,445.73 | -1,884,463,105.93 |
| 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) | 1,655,050,241.14 | 904,977,477.19 | 2,560,027,718.33 |

| 项目 | 上年度可比期间 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) | 2,719,838,246.22 | -238,630,916.02 | 2,481,207,330.20 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 768,199,652.88 | 768,199,652.88 |
| 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) | -124,759,952.94 | 30,037,648.33 | -94,722,304.61 |
| 其中:1.基金申购款 | 2,256,810,931.48 | 319,207,311.97 | 2,576,018,243.45 |
| 2.基金赎回款 | -2,381,570,884.42 | -289,169,663.64 | -2,670,740,548.06 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 2,595,078,293.28 | 559,606,385.19 | 3,154,684,678.47 |

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

华宝兴业新兴产业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")证监许可[2010]第1241号《关于核准华宝兴业新兴产业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《华宝兴业新兴产业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基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集3,632,254,340.43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(2010)第381号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金合同》于2010年12月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,632,789,229.65份基金份额,其中认购资金利息折合534,889.22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《华宝兴业新兴产业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具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行、上市的股票、债券、货币市场工具以及经中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具。本基金的股票投资比例为基金资产的60%-95%,其中投资于新兴产业相关股票的比例不低于股票资产的80%;权证的投资比例占基金资产的0%-3%;现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种的比例占基金资产的5%-40%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:中证新兴产业指数×75%+上证国债指数×25%。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝兴业基金管理有限公司于2014年8月29日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝兴业新兴产业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2014半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2014年6月30日的财务状况以及2014半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。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。

(5)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 | 2,057,207,209.75 | 79.18 |
| | 其中:股票 | 2,057,207,209.75 | 79.18 |
| 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 | 438,152,878.55 | 16.87 |
| 7 | 其他各项资产 | 102,627,392.90 | 3.95 |
| 8 | 合计 | 2,597,987,481.20 | 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

| 序号 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 82,008,840.12 | 3.20 |
| C | 制造业 | 838,363,202.17 | 32.75 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 16,293,047.72 | 0.64 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 48,443,769.50 | 1.89 |
| 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 | 498,310,475.55 | 19.47 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 645,355.48 | 0.03 |
| L | 租赁和商务服务业 | 216,370,604.52 | 8.45 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 24,319,209.60 | 0.95 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 261,659,472.33 | 10.22 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 37,707,573.56 | 1.47 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 33,085,659.20 | 1.29 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 2,057,207,209.75 | 80.36 |

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 | 7,053,732 | 206,321,661.00 | 8.06 |
| 2 | 002358 | 森源电气 | 5,711,322 | 134,965,464.92 | 5.27 |
| 3 | 300090 | 盛运股份 | 7,046,316 | 110,979,477.00 | 4.34 |
| 4 | 300212 | 易华录 | 3,362,405 | 105,310,524.60 | 4.11 |
| 5 | 002400 | 省广股份 | 4,180,116 | 102,747,251.28 | 4.01 |
| 6 | 300058 | 蓝色光标 | 3,434,106 | 91,141,173.24 | 3.56 |
| 7 | 300263 | 隆华节能 | 5,500,000 | 83,875,000.00 | 3.28 |
| 8 | 300026 | 红日药业 | 2,656,742 | 77,842,540.60 | 3.04 |
| 9 | 300025 | 华星创业 | 4,390,000 | 68,659,600.00 | 2.68 |
| 10 | 300157 | 恒泰艾普 | 5,193,918 | 67,209,298.92 | 2.63 |

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

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 300212 | 易华录 | 115,830,866.13 | 4.70 |
| 2 | 600422 | 昆明制药 | 81,284,650.24 | 3.29 |
| 3 | 300074 | 华平股份 | 80,305,576.82 | 3.26 |
| 4 | 300295 | 三六五网 | 78,243,352.86 | 3.17 |
| 5 | 000028 | 国药一致 | 59,737,159.94 | 2.42 |
| 6 | 300070 | 碧水源 | 57,956,490.22 | 2.35 |
| 7 | 002065 | 东华软件 | 56,387,960.98 | 2.29 |
| 8 | 002475 | 立讯精密 | 49,008,619.08 | 1.99 |
| 9 | 002711 | 欧浦钢网 | 48,546,297.85 | 1.97 |
| 10 | 000555 | 神州信息 | 45,715,309.04 | 1.85 |
| 11 | 002672 | 东江环保 | 45,534,684.13 | 1.85 |
| 12 | 600187 | 国中水务 | 43,771,174.38 | 1.77 |
| 13 | 600446 | 金证股份 | 43,535,800.28 | 1.76 |
| 14 | 300043 | 互动娱乐 | 41,919,856.83 | 1.70 |
| 15 | 002474 | 榕基软件 | 41,615,268.04 | 1.69 |
| 16 | 300168 | 万达信息 | 40,946,348.92 | 1.66 |
| 17 | 600633 | 浙报传媒 | 40,537,966.93 | 1.64 |
| 18 | 002665 | 首航节能 | 40,390,982.14 | 1.64 |
| 19 | 300072 | 三聚环保 | 39,600,438.47 | 1.61 |
| 20 | 300020 | 银江股份 | 36,331,980.61 | 1.47 |

注:买入金额不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 300315 | 掌趣科技 | 153,363,784.14 | 6.22 |
| 2 | 300074 | 华平股份 | 107,048,924.69 | 4.34 |
| 3 | 002236 | 大华股份 | 103,674,445.67 | 4.20 |
| 4 | 300295 | 三六五网 | 69,852,572.13 | 2.83 |
| 5 | 600422 | 昆明制药 | 67,156,805.42 | 2.72 |
| 6 | 300263 | 隆华节能 | 64,810,724.89 | 2.63 |
| 7 | 002303 | 美盈森 | 61,426,651.66 | 2.49 |
| 8 | 002310 | 东方园林 | 56,375,329.90 | 2.29 |
| 9 | 300133 | 华策影视 | 51,863,970.93 | 2.10 |
| 10 | 300027 | 华谊兄弟 | 50,465,463.06 | 2.05 |
| 11 | 002474 | 榕基软件 | 48,688,242.58 | 1.97 |
| 12 | 300359 | 全通教育 | 46,567,168.19 | 1.89 |
| 13 | 002475 | 立讯精密 | 41,352,677.63 | 1.68 |
| 14 | 300002 | 神州泰岳 | 40,261,244.71 | 1.63 |
| 15 | 300266 | 兴源过滤 | 39,392,565.70 | 1.60 |
| 16 | 600633 | 浙报传媒 | 39,332,076.92 | 1.59 |
| 17 | 300136 | 信维通信 | 38,807,868.04 | 1.57 |
| 18 | 002711 | 欧浦钢网 | 38,056,501.23 | 1.54 |
| 19 | 300147 | 香雪制药 | 36,539,008.76 | 1.48 |
| 20 | 300124 | 汇川技术 | 35,013,552.96 | 1.42 |

注:卖出金额不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票成本(成交)总额 | 1,999,354,972.12 |
| 卖出股票收入(成交)总额 | 2,261,461,750.61 |

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.8 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.11.9 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

7.11.10 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.8

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。

7.12.9

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。

7.12.10 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 | 703,302.30 |
| 2 | 应收证券清算款 | 100,014,712.85 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 75,192.93 |
| 5 | 应收申购款 | 1,834,184.82 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |