

华宝兴业资源优选股票型证券投资基金

2014年半年度报告摘要

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

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

项目	本期	上年度可比期间
2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日	
当期发生的基金应支付的管理费	502,676.11	575,933.08
其中:支付销售机构的客户维护费	133,818.62	129,929.21

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:

日管理费=前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

项目	本期	上年度可比期间
2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	83,812.69	95,988.81

注:支付基金托管人中国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。

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

项目	本期	上年度可比期间
2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日	
期初持有的基金份额	422,523.24	293,904.22
期间因买入交易新增	-	-
期间因卖出变动减少	-	-
期末持有的基金份额	422,523.24	293,904.22
占基金总份额的比例	6.44%	0.43%

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

关联方名称	本期	上年度
2014年6月30日	2013年12月31日	
持有的基金份额	持有的基金份额	持有的基金份额
占基金总份额的比例	占基金总份额的比例	占基金总份额的比例
宝盈基金有限公司	29,999,000.00	30,905
	29,999,000.00	30,22%

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

关联方名称	本期	上年度可比期间
2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日	
中国银行	期末余额	当期利息收入
	3,888,921.31	22,735.45
	6,875,750.31	54,978.75

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期间参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 其他关联方交易事项的说明

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(2014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

本基金本报告期末持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

股票代码	股票简称	停牌日期	停牌原因	期末止持数量(股)	期末成本总额	期末公允价值	备注
00096	中投证券	2014年5月6日	重大资产重组停牌	12.44	2014年6月5日	13.68	60,000
					674,835.00	746,400.00	-

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不多。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法
根据在公允价值计量中对计量输入值的重要性的最低层级输入值,公允价值输入值可分为:第一层级,相同资产或负债在活跃市场中未经调整的报价。第二层级,直接比如报价或间接比如根据价格推导出的可观察到的输入值。第三层级,根据对市场公允价值的不可观察输入值。各层级金融工具公允价值

于2014年6月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为57,076,710.60元,属于第二层级的余额为746,400.00元,无属于第三层级的余额;2013年12月31日,第一层级的余额为63,928,405.78元,属于第二层级的余额为2,288,100.00元,无属于第三层级的余额。

(ii) 公允价值所属层级间的重大变动

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级,并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应归属第二层级还是第三层级。

(iii) 期末公允价值与公允价值本期变动金额
无。

(iv) 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

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	57,823,110.50	83.59
其中:股票	57,823,110.50	83.59	
2	固定收益投资	-	-
其中:债券	-	-	-
3	基金投资	-	-
4	资产支持证券投资	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	6,000,000.00	8.67
其中:买入返售金融资产-买入返售金融资产	-	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,230,143.78	6.12
8	其他各项资产	1,118,056.95	1.62
合计	69,171,311.23	100.00	

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	1,050,700.00	1.54
B	采矿业	36,019,602.30	52.63
C	制造业	13,120,224.29	19.17
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
E	建筑业	3,683,300.00	5.39
F	批发和零售业	493,324.00	0.72
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	-	-
J	金融业	1,180,200.00	1.72
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	515,760.00	0.75
O	医药制造业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	1,755,000.00	2.56
合计	57,823,110.50	84.49	

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

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	600256	广汇能源	4,663,951.74	6.18	
2	601225	XDP陕西煤业	3,132,767.01	4.15	
3	601088	宁波海运	2,791,064.37	3.70	
4	600352	浙江广厦	2,621,455.10	3.47	
5	601857	中国广核	2,588,147.95	3.43	
6	002140	东方科技	2,211,079.24	2.93	
7	600459	贵研铂业	2,123,232.52	2.81	
8	601992	金隅股份	1,015,033.66	1.37	
9	000411	冀东能源	1,995,885.80	2.65	
10	002407	德化集团	1,991,260.50	2.64	
11	600028	中国石化	1,850,600.00	2.45	
12	000970	中科三环	1,636,047.34	2.17	
13	000983	西山煤电	1,548,479.95	2.05	
14	000933	神火股份	1,522,630.23	2.02	
15	600546	山煤国际	1,512,598.10	2.01	
16	000888	峨边山A	1,434,916.00	1.91	
17	600739	辽宁成大	1,422,844.00	1.89	
18	600899	紫光股份	1,395,500.00	1.85	
19	300068	南都电源	1,381,435.07	1.83	
20	601808	中信油服	1,301,041.62	1.72	

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

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600256	广汇能源	4,791,864.44	6.35
2	600352	浙江广厦	3,042,086.94	4.03
3	601992	金隅股份	2,833,660.91	3.75
4	002051	贵州茅台	2,510,745.58	3.38
5	000411	冀东能源	2,285,372.00	3.03
6	600459	贵研铂业	2,132,409.17	2.83
7	002407	德化集团	1,949,086.90	2.58
8	600157	永泰能源	1,853,805.65	2.46
9	601225	XDP陕西煤业	1,815,247.00	2.41
10	600111	包钢稀土	1,699,467.00	2.13
11	600928	中国石化	1,566,200.00	2.08
12	600780	通宝能源	1,551,338.36	2.06
13	002140	东方科技	1,525,615.51	2.02
14	600366	宁波海运	1,511,140.50	2.00
15	600108	金盾集团	1,498,596.30	1.99
16	002400	士兰股份	1,462,143.00	1.94
17	300068	南都电源	1,317,363.73	1.73
18	600739	辽宁成大	1,268,738.83	1.68
19	000830	鲁西化工	1,267,200.00	1.68
20	600403	大有能源	1,264,360.33	1.68

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

买入股票成本(成交总额)	卖出股票收入(成交总额)
66,361,190.91	69,552,747.01

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 期末按投资组合品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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。

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

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

7.11.3 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

7.12.1

2014年1月13日中国石化发布公告:国务院对山东省青岛市“11·22”中石化东黄输油管道泄漏爆炸特别重大事故调查处理报告已作出批复,同意国务院事故调查组的调查处理结果,对中国石化及当地政府的48名责任人分别给予纪律处分,对涉嫌犯罪的15名责任人移送司法机关依法追究法律责任。根据国务院事故调查组的统计,本次事故造成直接经济损失人民币7.172亿元,公司将根据相应赔偿责任。

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

报告期内,本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	11,628.18
2	应收证券清算款	1,093,975.99
3	应收股利	-
4	应收利息	9,403.96
5	应收申购款	3,948.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	预付账款	-
9	合计	1,118,056.95

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

序号	名称	金额
1	存在保证金	11,628.18
2	应收证券清算款	1,093,975.99
3	应收股利	-
4	应收利息	9,403.96
5	应收申购款	3,948.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	预付账款	-
9	合计	1,118,056.95

8.2 期末基金管理人从业人数持有本基金的情况

项目	持有基金份额(股)	占基金总份额比例
基金管理人从业人员持有本基金	521,366.05	0.5819%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额区间的情况

项目	持有基金份额总量的区间情况(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究人员持有本基金基金份额	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10-50

9 开放式基金份额变动

项目	持有基金份额总量的区间情况(万份)
基金合同生效日(2012年8月21日)基金份额总额	502,977,780.44
本报告期间基金份额总额变动	99,268,197.72
本报告期末基金份额总额	22,351,814.84
本报告期末基金份额总额变动	24,730,486.85
本报告期末基金份额总额	96,889,522.71

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

本报告期间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(人)的重大人事变动

1.基金管理人发生重大人事变动
(1)2014年3月24日,基金管理人发布《华宝兴业基金管理有限公司关于聘任常务副总经理的公告》,Alexandre Werno先生(2014年3月13日)担任常务副总经理职务。
(2)2014年3月31日,基金管理人发布《华宝兴业基金管理有限公司关于聘任副总经理的公告》,刘伟先生(2014年3月31日)担任副总经理职务。
2.基金管理人的人事变动
2014年2月14日中国银行股份有限公司公告,2014年2月13日起,西南西北担任本行行长。
报告期内,本基金管理人及基金托管人基金托管部无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼

本报告期间无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期间本基金的投资