

华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金 2013 年半年度报告（摘要）

2013 年 6 月 30 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

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	华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金
基金简称	华宝兴业多策略股票
基金主代码	240005
交易代码	240005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 5 月 11 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	8,024,142,544.07 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过各风格板块间资产配置以及各板块内精选个股，在控制风险的前提下为持有人谋求最大回报。
投资策略	本基金看好中国经济的发展前景和证券市场存在的投资机会，注重资产在各风格板块间的配置，同时在各风格板块内部精选个股。
业绩比较基准	80%×上证 180 指数和深证 100 指数的复合指数+20%×上证国债指数 $\text{复合指数} = (\text{上证 180 流通市值} / \text{成分指数总流通市值}) \times \text{上证 180 指数} + (\text{深证 100 流通市值} / \text{成分指数总流通市值}) \times \text{深证 100 指数}$ $\text{成分指数总流通市值} = \text{上证 180 流通市值} + \text{深证 100 流通市值}$
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
	联系电话	021-38505888
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com
		田青
		010-67595096
		tianqingl.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	-355, 311, 846. 57
本期利润	-16, 305, 632. 37
加权平均基金份额本期利润	-0. 0020
本期加权平均净值利润率	-0. 40%
本期基金份额净值增长率	-0. 70%
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	-1, 987, 505, 955. 01
期末可供分配基金份额利润	-0. 2477
期末基金资产净值	3, 755, 135, 614. 81
期末基金份额净值	0. 4680
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	221. 57%

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期末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	-10.52%	2.02%	-12.43%	1.50%	1.91%	0.52%
过去三个月	-0.76%	1.45%	-8.97%	1.17%	8.21%	0.28%
过去六个月	-0.70%	1.34%	-10.09%	1.23%	9.39%	0.11%
过去一年	-2.36%	1.27%	-7.02%	1.11%	4.66%	0.16%
过去三年	-13.64%	1.27%	-8.30%	1.10%	-5.34%	0.17%
自基金合同生效日起至 今	221.57%	1.42%	91.48%	1.48%	130.09%	-0.06%

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：80%×上证 180 指数和深证 100 指数的复合指数+20%×上证国债指数
 复合指数=（上证 180 流通市值 / 成分指数总流通市值）× 上证 180 指数+（深圳 100 流通市值 / 成分指数总流通市值）×深证 100 指数

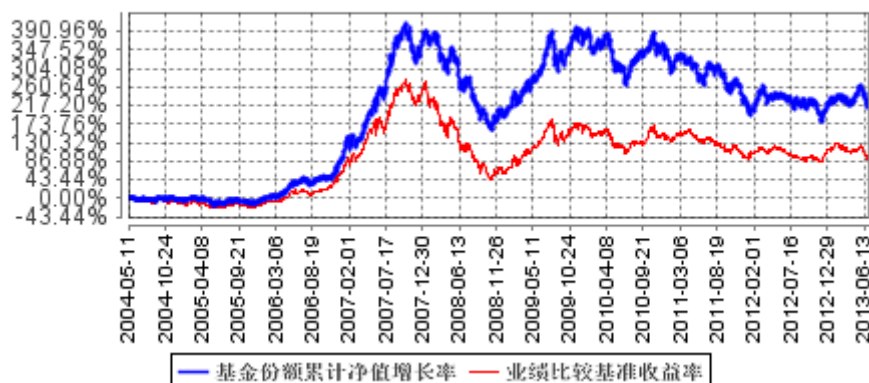
成分指数总流通市值=上证 180 流通市值+深圳 100 流通市值

流通市值采用上一交易日收盘市值

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

（2004 年 5 月 11 日至 2013 年 6 月 30 日）

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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 2004 年 11 月 11 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

基金管理人是在 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		
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、华宝兴业大盘精选基金基金经理	2013 年 2 月 8 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。
牟旭东	本基金基金经理、投资副总监	2007 年 10 月 11 日	2013 年 2 月 8 日	16 年	硕士。曾在南方证券有限公司从事证券研究工作, 2003 年 1 月加入本公司, 先后任高级分析师, 研究部副总经理, 研究部总经理, 2007 年 10 月至 2013 年 2 月任华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金经理, 2009 年 2 月至 2011 年 2 月兼任华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理, 2010 年 1 月至 2012 年 1 月兼任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理, 2010 年 7 月-2012 年 3 月任国内投资部总经理, 2012 年 4 月至 2013 年 4 月任投资副总监。

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合规守信情况的说明

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、《华宝兴业多策略增长开放式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

2013 年上半年，国内经济前高后低，流动性形势前松后紧。2012 年 4 季度以来，国内经济增长短暂企稳回升，不过受制于过剩产能、出口动力衰竭等中长期约束，回升动力在 2013 年春节之后逐步回落，3、4 月份旺季效应并不明显，二季度 GDP 增速更是回落至 7.5%的较低水平，经济再显疲弱之势。与此同时，年初以来的流动性形势也呈前松后紧态势，源自去年年底以来的外汇占款持续增加，叠加巨量社会融资资金投入，流动性形势整体宽松，但随着银监会 8 号文、10 号文等政策出台，尤其二季度末爆发的银行间“钱荒”事件，导致市场对流动性转向的担忧越发明显。海外市场方面，日元持续大幅贬值，美国经济复苏进一步确认，共同推动美元指数大涨，新兴市

场面临较大资金外流压力。在此背景下，上证指数自去年底 1949 点以来的反弹未能持续，并在银行“钱荒”事件的刺激下再创新低，不过 A 股市场的结构性投资机会明显，以医药、环保、传媒、通信、新能源汽车等代表未来转型方向的板块涨幅可观。

本基金在此期间仓位波动不大，主要进行结构调整，较大幅度降低金融、地产、食品饮料等行业的配置，适度增仓医药、通信、新能源汽车等成长股板块，操作思路方面持续优化大盘价值、大盘成长、小盘价值、小盘成长的配置，并较大幅度增仓大盘成长及小盘成长相关个股，不过在小盘成长方面加仓力度略有不足，未能创造更好的超额收益。

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-0.70%，同期业绩比较基准收益率为-10.09%，基金表现领先于基准 9.39%。

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 2013 年下半年，政策预期方面，习总书记强调“再也不能简单以国内生产总值增长率来论英雄”，李克强总理关于“经济增长率、就业水平等不滑出下限，物价涨幅等不超出上限”的表态，均表明新一届政府在调结构、促转型方面的决心，而目前经济状况还处于合理状态，出台大规模刺激政策的概率很小，不过底线思维又决定稳增长亦是下半年的重要任务，经济增速有望稳定在 7.3%至 7.5%的区间以内。流动性趋势方面，随着各项监管措施的落实，影子银行的拓展势头将有所收敛，叠加美元走强等因素影响，外汇流入形势可能不如上半年，下半年流动性趋紧的态势明确，不过二季度末出现的“钱荒”不至于再现，更多是维持紧平衡状态。同时，经济持续低迷、流动性从紧可能传导至上市公司业绩层面，传统行业盈利难以乐观，部分预期过高的成长板块也有证伪的风险。综上判断，下半年市场走势难言乐观，不过随着前期悲观情绪宣泄，短期流动性最为紧张的时间已经过去，同时将于下半年召开的十八届三中全会也会激发市场对于经济改革的憧憬，我们预计市场走势有望企稳，并在环保、新能源、大众消费、医药、铁路设备、信息服务及设备等领域存在结构性机会。

本基金计划在下半年维持中性仓位，持续重视结构调整，并在契约规定的范围内进一步优化大盘价值、大盘成长、小盘价值、小盘成长之间的配置，深度挖掘估值较低、盈利确定改善的价值股及估值合理、中长期成长空间明确的成长股。

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其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关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：华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金

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		279,018,730.02	372,763,098.52
结算备付金		10,210,682.52	3,738,005.18
存出保证金		1,549,689.15	1,943,224.43
交易性金融资产		3,481,280,935.06	3,392,269,427.37
其中：股票投资		3,231,743,935.06	2,992,614,427.37
基金投资		-	-
债券投资		249,537,000.00	399,655,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	264,600,836.90
应收证券清算款		-	15,160,225.58
应收利息		5,768,866.27	5,704,335.85
应收股利		759,938.44	-
应收申购款		134,943.94	412,916.83
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		3,778,723,785.40	4,056,592,070.66
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		-	14,878,226.91
应付赎回款		4,481,561.46	2,930,964.94
应付管理人报酬		4,892,673.30	4,766,567.95
应付托管费		815,445.56	794,427.99

应付销售服务费		-	-
应付交易费用		12,623,939.75	3,317,575.52
应交税费		43,748.40	43,748.40
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		730,802.12	953,921.36
负债合计		23,588,170.59	27,685,433.07
所有者权益：			
实收基金		3,496,695,201.55	3,725,474,862.53
未分配利润		258,440,413.26	303,431,775.06
所有者权益合计		3,755,135,614.81	4,028,906,637.59
负债和所有者权益总计		3,778,723,785.40	4,056,592,070.66

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.4680 元，基金份额总额 8,024,142,544.07 份。

6.2 利润表

会计主体：华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金

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		35,286,617.61	100,728,943.05
1.利息收入		7,073,267.77	7,385,183.78
其中：存款利息收入		1,470,901.86	1,974,709.43
债券利息收入		4,758,291.33	3,127,211.02
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		844,074.58	2,283,263.33
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-311,038,737.30	-306,016,501.70
其中：股票投资收益		-343,344,506.45	-327,102,852.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益		2,435,359.22	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		29,870,409.93	21,086,350.56
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		339,006,214.20	399,022,708.46
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		245,872.94	337,552.51
减：二、费用		51,592,249.98	42,805,423.34

1. 管理人报酬		29,997,604.25	33,082,162.88
2. 托管费		4,999,600.77	5,513,693.78
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		16,364,809.74	3,975,449.27
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		230,235.22	234,117.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-16,305,632.37	57,923,519.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-16,305,632.37	57,923,519.71

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金

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）	3,725,474,862.53	303,431,775.06	4,028,906,637.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-16,305,632.37	-16,305,632.37
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）	-228,779,660.98	-28,685,729.43	-257,465,390.41
其中：1. 基金申购款	39,743,553.88	4,611,300.24	44,354,854.12
2. 基金赎回款	-268,523,214.86	-33,297,029.67	-301,820,244.53
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）	3,496,695,201.55	258,440,413.26	3,755,135,614.81
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)	4,110,328,756.62	364,985,118.39	4,475,313,875.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	57,923,519.71	57,923,519.71
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)	-226,081,984.79	-35,048,036.32	-261,130,021.11
其中：1.基金申购款	95,175,845.90	12,017,308.07	107,193,153.97
2.基金赎回款	-321,257,830.69	-47,065,344.39	-368,323,175.08
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)	3,884,246,771.83	387,860,601.78	4,272,107,373.61

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：

黄小蕙

基金管理人负责人

向辉

主管会计工作负责人

张幸骏

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金(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[2004]第 41 号《关于同意华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金设立的批复》核准,由华宝兴业基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金契约》(后更名为《华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金合同》)发起,并于 2004 年 5 月 11 日募集成立。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 5,229,237,143.39 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(2004)第 74 号验资报告予以验证。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《华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金招募说明书》和《关于对华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金实施基金份额拆分的公告》的有关规定，本基金于 2008 年 1 月 8 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 2.294784076，并于 2008 年 1 月 8 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金合同》和最新公布的《华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金更新的招募说明书》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。在正常的市场情况下，本基金的股票投资比例范围为基金资产净值的 50%-95%，债券为 0%-45%，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：复合指数×80% + 上证国债指数×20%；其中，复合指数 = (上证 180 流通市值/成分指数总流通市值) × 上证 180 指数 + (深证 100 流通市值/成分指数总流通市值) × 深证 100 指数；其中，成分指数总流通市值 = 上证 180 流通市值 + 深证 100 流通市值。

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《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》、《华宝兴业多策略增长开放式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 年上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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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

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

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	29,997,604.25	33,082,162.88
其中：支付销售机构的客户维护费	3,249,744.22	3,473,943.64

注：支付基金管理人华宝兴业的基金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。

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	4,999,600.77	5,513,693.78

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。

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	上年度可比期间
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
期初持有的基金份额	1,709,464.75	1,709,464.75
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	225,515.07	-
期末持有的基金份额	1,483,949.68	1,709,464.75
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。

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		上年度可比期间	
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		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
建设银行	279,018,730.02	1,388,313.15	279,041,814.23	1,959,028.66

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

本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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
000999	华润三九	2013 年 6 月	重大事项	26.55	2013 年 8 月	26.51	360,000	9,956,160.91	9,558,000.00	-

		3 日	停牌		19 日					
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	149,928	2,353,530.04	3,580,280.64	-

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

(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)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2013 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 3,218,605,654.42 元，属于第二层级的余额为 262,675,280.64 元，无属于第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日：第一层级 2,992,614,427.37 元，第二层级 399,655,000.00 元，无第三层级)。

(iii) 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，本基金分别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不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影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

于本期末，本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具(2012 年 12 月 31 日：同)。本基金本期净转入/(转出)第三层级零元，计入损益的第三层级金融工具公允价值变动零元(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	3,231,743,935.06	85.52
	其中：股票	3,231,743,935.06	85.52
2	固定收益投资	249,537,000.00	6.60
	其中：债券	249,537,000.00	6.60
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	289,229,412.54	7.65
6	其他各项资产	8,213,437.80	0.22
7	合计	3,778,723,785.40	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	1,830,000.00	0.05
B	采矿业	-	-

C	制造业	2,173,318,151.24	57.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	149,755,630.29	3.99
F	批发和零售业	37,548,531.85	1.00
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	320,700,289.61	8.54
J	金融业	-	-
K	房地产业	268,106,178.39	7.14
L	租赁和商务服务业	36,616,770.00	0.98
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	233,561,035.04	6.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,727,068.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	3,580,280.64	0.10
S	综合	-	-
	合计	3,231,743,935.06	86.06

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	300144	宋城股份	17,500,000	232,750,000.00	6.20
2	002594	比亚迪	7,150,921	213,884,047.11	5.70
3	000012	南玻A	16,660,441	154,442,288.07	4.11
4	002690	美亚光电	5,660,502	136,021,863.06	3.62
5	002475	立讯精密	6,159,510	129,349,710.00	3.44
6	002415	海康威视	3,460,000	122,276,400.00	3.26
7	000002	万科A	12,399,807	122,138,098.95	3.25
8	600519	贵州茅台	549,813	105,767,526.81	2.82
9	600048	保利地产	9,999,898	99,098,989.18	2.64
10	002230	科大讯飞	2,000,000	92,400,000.00	2.46

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	000002	万 科A	243,931,414.65	6.05
2	002594	比亚迪	202,768,619.04	5.03
3	000012	南 玻A	185,105,839.10	4.59
4	600048	保利地产	161,770,766.17	4.02
5	600104	上汽集团	147,687,650.05	3.67
6	601166	兴业银行	135,265,923.87	3.36
7	601328	交通银行	125,304,770.46	3.11
8	002415	海康威视	125,247,321.58	3.11
9	000063	中兴通讯	122,826,790.23	3.05
10	600519	贵州茅台	118,849,279.24	2.95
11	600028	中国石化	116,149,716.47	2.88
12	600498	烽火通信	107,431,636.81	2.67
13	600030	中信证券	99,026,393.13	2.46
14	601398	工商银行	98,925,987.58	2.46
15	600016	民生银行	97,626,195.96	2.42
16	600153	建发股份	91,902,649.42	2.28
17	000800	一汽轿车	88,499,855.94	2.20
18	601288	农业银行	88,040,654.73	2.19
19	300068	南都电源	84,631,655.12	2.10
20	000651	格力电器	83,130,951.11	2.06

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	002230	科大讯飞	316,679,700.44	7.86
2	600809	山西汾酒	257,112,523.82	6.38

3	002410	广联达	177,231,198.14	4.40
4	600125	铁龙物流	171,015,189.60	4.24
5	002310	东方园林	140,621,052.01	3.49
6	600498	烽火通信	139,063,202.41	3.45
7	600104	上汽集团	135,238,179.48	3.36
8	000063	中兴通讯	126,071,985.91	3.13
9	601166	兴业银行	120,712,173.94	3.00
10	601328	交通银行	120,320,109.53	2.99
11	600557	康缘药业	110,914,506.82	2.75
12	600028	中国石化	109,543,138.79	2.72
13	600559	老白干酒	100,478,461.58	2.49
14	600383	金地集团	99,661,955.64	2.47
15	600030	中信证券	97,041,905.58	2.41
16	600016	民生银行	96,504,914.98	2.40
17	000002	万科A	93,583,444.35	2.32
18	601398	工商银行	91,608,044.08	2.27
19	000848	承德露露	90,302,882.58	2.24
20	600519	贵州茅台	77,100,390.49	1.91

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	5,540,699,849.16
卖出股票收入（成交）总额	5,299,157,324.84

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	149,300,000.00	3.98
	其中：政策性金融债	149,300,000.00	3.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	100,237,000.00	2.67
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	249,537,000.00	6.65

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	120245	12 国开 45	1,000,000	99,470,000.00	2.65
2	041255016	12 新业国资 CP001	500,000	50,265,000.00	1.34
3	120238	12 国开 38	500,000	49,830,000.00	1.33
4	041361011	13 杭氧 CP001	300,000	29,856,000.00	0.80
5	041264022	12 浦路桥 CP001	200,000	20,116,000.00	0.54

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

2013 年 2 月 23 日贵州茅台酒股份有限公司发布公告：贵州茅台酒股份有限公司控股子公司贵州茅台酒销售有限公司于 2013 年 2 月 22 日收到贵州省物价局《行政处罚决定书》（黔价处[2013]1 号）。该决定书认为：贵州茅台酒销售有限公司对全国经销商向第三人销售茅台酒的最低价格进行限定，违反了《中华人民共和国反垄断法》第十四条的规定。本基金管理人通过对该上市公司进行进一步了解和他分析，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

管理人对贵州茅台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。

7.10.2

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	1,549,689.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	759,938.44
4	应收利息	5,768,866.27
5	应收申购款	134,943.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,213,437.80

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

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
229,904	34,902.14	97,426,827.91	1.21%	7,926,715,716.16	98.79%

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	1,450,200.66	0.0181%

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：
10 万份至 50 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：
0

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（2004 年 5 月 11 日）基金份额总额	5,233,338,344.60
本报告期期初基金份额总额	8,549,133,269.58
本报告期基金总申购份额	91,201,736.04
减：本报告期基金总赎回份额	616,192,461.55
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	8,024,142,544.07

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，由黄小蕙女士代任。

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

本基金的投资策略在报告期内未发生变更。

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(2004 年 5 月 11 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	
长江证券	1	3,769,920,892.27	34.79%	3,375,475.89	34.46%	-
海通证券	1	1,536,621,309.83	14.18%	1,398,940.83	14.28%	-
国泰君安	1	1,486,853,267.09	13.72%	1,353,623.27	13.82%	-
中信建投	1	1,458,132,553.22	13.46%	1,327,479.81	13.55%	-
国金证券	1	1,138,234,060.53	10.50%	1,036,250.83	10.58%	-
申银万国	1	717,446,937.14	6.62%	649,290.08	6.63%	-
东兴证券	1	301,972,161.05	2.79%	268,789.10	2.74%	-
招商证券	1	149,469,382.44	1.38%	134,265.32	1.37%	-
光大证券	1	115,855,268.09	1.07%	105,476.61	1.08%	-
国元证券	1	112,505,739.33	1.04%	102,425.23	1.05%	-
银河证券	2	48,885,823.01	0.45%	44,505.85	0.45%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华泰联合	1	-	-	-	-	-
山西证券	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：资质雄厚，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山西证券，退租东吴证券。

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
长江证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	17,105,007.40	100.00%	680,000,000.00	98.55%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	10,000,000.00	1.45%	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-

华宝兴业基金管理有限公司
2013 年 8 月 24 日