

# 华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金 2015 年半年度报告（摘要）

2015 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：2015 年 8 月 28 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 2015 年 8 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 2015 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	华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金
基金简称	华宝兴业医药生物
基金主代码	240020
交易代码	240020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 2 月 28 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	521,030,486.87 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	把握医药生物相关行业的投资机会，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，决定大类资产配置比例。通过对医药生物相关行业的辨识、精选以及对医药生物行业相关股票的深入分析，挖掘该类型企业的投资价值。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	80%×中证医药卫生指数+20%×上证国债指数
风险收益特征	本基金是一只积极型的股票投资基金，属于证券投资基金中较高预期风险和预期收益的品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

### 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	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(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	154,735,057.40
本期利润	478,346,385.62
加权平均基金份额本期利润	0.8081
本期加权平均净值利润率	47.21%
本期基金份额净值增长率	64.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	230,886,226.15
期末可供分配基金份额利润	0.4431
期末基金资产净值	1,046,250,937.25
期末基金份额净值	2.008
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	150.78%

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	-10.95%	3.79%	-8.19%	2.94%	-2.76%	0.85%
过去三个月	26.37%	2.95%	16.05%	2.26%	10.32%	0.69%
过去六个月	64.05%	2.29%	43.65%	1.77%	20.40%	0.52%
过去一年	64.32%	1.80%	62.40%	1.38%	1.92%	0.42%
过去三年	133.07%	1.51%	93.71%	1.20%	39.36%	0.31%
自基金合同生效日起至 今	150.78%	1.45%	103.15%	1.18%	47.63%	0.27%

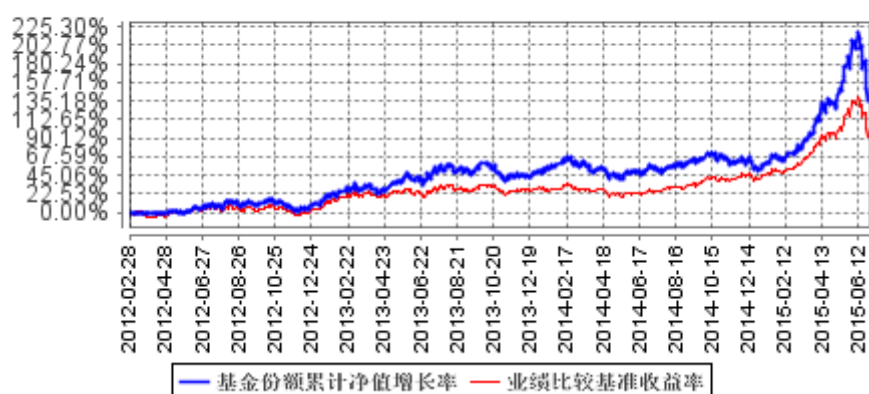
注：1、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

2、本基金业绩比较基准为：80%×中证医药卫生指数+20%×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

(2012年2月28日至2015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2012年8月28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（2015 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、华宝兴业活期货币市场基金、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、华宝兴业生态中国基金、华宝兴业量化对冲基金、华宝兴业高端制造基金、华宝兴业品质生活基金、华宝兴业稳健回报基金、华宝兴业事件驱动基金、华宝兴业国策导向基金、华宝兴业新价值基金、华宝兴业新机遇基金、华宝兴业医疗分级基金、华宝兴业中证 1000 分级基金和华宝兴业万物互联基金，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 110,943,781,389.61 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	助理投资总监、本基金基金经理、华宝兴业行业精选基金经理	2012 年 2 月 28 日	-	15 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

					至 2014 年 10 月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, 2014 年 6 月任助理投资总监。
王智慧	助理投资总监、本基金基金经理、华宝兴业大盘精选基金经理、华宝兴业多策略基金经理	2012 年 2 月 28 日	-	14 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、研究部总经理的职务, 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, 2014 年 6 月任助理投资总监。

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、《华宝兴业医药生物优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

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，我司服务优选基金与事件驱动基金于 6 月 11 日对股票——尚荣医疗（002551）发生同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日市场成交量的 5%。发生反向交易的原因是由于该两只基金投资策略不同，且事件驱动基金处于建仓期进行买入，服务优选为实现收益卖出。两只基金操作行为均符合相关法律法规和基金契约的规定，同时符合我司内部公平交易和异常交易相关的制度，不涉及利益输送行为。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

本报告期内，沪深两市创业板、中小板等新兴成长股出现了大幅上涨的格局，在报告期末段，市场又出现了历史罕见的断崖式暴跌行情走势。年初以来市场在流动性好转、降息、降准等利好影响下，场内存量资金和场外新增资金等在市场赚钱的带动下，市场的日成交量不断刷新历史记录，呈现出成长股、题材股等快速上涨的逼空行情，尤其是以“互联网+”等为代表的新兴行业、



以“一带一路”等为带动的传统优势制造业表现出更强的市场表现，6月初之前上证指数一度上涨到5000点以上，创业板指数一度上涨到4000点以上；6月中旬开始行情急转直下，短期的快速上涨和市场估值过高形成的泡沫在外围过高杠杆资金的严控下，在二季度末期出现了暴跌式走势，泥沙聚下的行情走势历史罕见，行情的集体踩踏现象终于出现了。

报告期内，医药指数跟随成长股的步伐表现出大幅上涨的节奏，其中以互联网医疗、移动医疗设备、基金诊断、干细胞等新技术、新模式的医疗生态的子行业表现更突出。但从6月初开始却急转之下，行业指数大幅快速下跌，由于估值的过高和短期涨幅的过大，医药成长股的泡沫不断强化，风险越来越大。

报告期间，由于相对看好市场和行业前景，本基金在前期一直保持高仓位运行，适度增加了互联网医疗、移动医疗设备、基金诊断、干细胞等新技术、新模式的医疗生态相关上市公司的配置比重，在后期对市场过快上涨后泡沫的担忧，主动降低了仓位。同时，对股票的结构适当地进行调整，增加估值合理、业绩确定性比较强的大盘医药蓝筹股，降低了新型的医药成长股，尤其是估值过高的股票比重，效果不错。

#### 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64.05%，同期业绩比较基准收益率为43.65%，基金表现领先于业绩基准20.40%。

#### 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2015年全年，由于国家目前对股市的积极救市态度可能对未来指数的止跌回稳有很大的支撑作用，考虑到股市接下来的运行可能以慢牛行情，估值合理、安全边际为考虑配置资产的核心要素，另外医药行业和医药指数在相对弱势的大盘格局下，具有相对的防御性特征。

医药政策层面，我们认为2015年药品招标的进程将可能加速推进；低价药政策将进入落实阶段；反商业贿赂将加速国产替代。未来几年内医药行业的上市公司增长将主要来自两个主要方面，内生式增长和外延式收购相得益彰。新医药商业模式和新技术的推广将可能表现得更加突出。下半年本基金将以相对谨慎的心态对资产和股票的配置微调，以公司基本面和安全边际作为考虑的主要指标，以确定性较强的成长性来选择优秀好公司。

#### 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

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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：华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		154,148,642.40	81,741,094.40
结算备付金		127,293.69	602,004.63
存出保证金		228,725.82	437,857.44
交易性金融资产		923,513,661.36	697,198,401.86
其中：股票投资		923,513,661.36	696,929,876.94
基金投资		-	-
债券投资		-	268,524.92
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		-	-
应收利息		34,295.42	27,197.60
应收股利		-	-
应收申购款		2,309,244.29	627,460.96
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,080,361,862.98	780,634,016.89
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2014 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			

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		2,250.01	-
应付赎回款		29,153,345.74	3,468,727.06
应付管理人报酬		1,557,896.57	1,231,012.55
应付托管费		259,649.42	205,168.74
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		2,756,268.12	2,372,281.10
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		381,515.87	487,929.07
负债合计		34,110,925.73	7,765,118.52
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		521,030,486.87	631,531,070.26
未分配利润		525,220,450.38	141,337,828.11
所有者权益合计		1,046,250,937.25	772,868,898.37
负债和所有者权益总计		1,080,361,862.98	780,634,016.89

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.008 元，基金份额总额 521,030,486.87 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		489,239,740.59	29,672,206.89
1.利息收入		431,815.04	896,590.60
其中：存款利息收入		431,407.55	488,631.19
债券利息收入		407.49	407,959.41
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		162,312,609.89	12,599,426.10
其中：股票投资收益		158,859,481.14	6,918,704.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益		383,391.31	-
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		3,069,737.44	5,680,721.53
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		323,611,328.22	15,083,079.71
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		2,883,987.44	1,093,110.48
<b>减：二、费用</b>		10,893,354.97	10,466,701.27
1. 管理人报酬		7,489,544.97	7,472,707.46
2. 托管费		1,248,257.50	1,245,451.18
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		1,985,442.60	1,582,776.76
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		170,109.90	165,765.87
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		478,346,385.62	19,205,505.62
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		478,346,385.62	19,205,505.62

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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）	631,531,070.26	141,337,828.11	772,868,898.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	478,346,385.62	478,346,385.62
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）	-110,500,583.39	-94,463,763.35	-204,964,346.74
其中：1.基金申购款	439,993,390.29	301,626,772.87	741,620,163.16
2.基金赎回款	-550,493,973.68	-396,090,536.22	-946,584,509.90
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）	521,030,486.87	525,220,450.38	1,046,250,937.25
项目	上年度可比期间 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）	701,658,113.43	138,300,649.14	839,958,762.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,205,505.62	19,205,505.62
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）	273,263,916.68	58,965,212.99	332,229,129.67
其中：1.基金申购款	611,807,848.18	146,439,002.32	758,246,850.50
2.基金赎回款	-338,543,931.50	-87,473,789.33	-426,017,720.83
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）	974,922,030.11	216,471,367.75	1,191,393,397.86

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

华宝兴业医药生物优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”)证监许可[2011]1115号文《关于核准华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由华宝兴业基金管理有限公司作为发起人于2012年1月30日至2012年2月24日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所有限公司验证并出具安永华明(2012)验字第60737318\_B01号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基

金合同于 2012 年 2 月 28 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 554,322,041.80 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 75,200.74 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 554,397,242.54 元，折合 554,397,242.54 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，注册登记机构为华宝兴业基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的 A 股股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的股票投资比例为基金资产的 60%–95%，其中，投资于医药生物相关股票的比例不低于股票资产的 80%。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占基金资产比例为 5%–40%，其中，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。其它金融工具的投资比例依照法规和监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为：80%中证医药卫生指数+20%上证国债指数。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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。

采用若干修订后/新会计准则

2014 年 1 至 3 月，财政部制定了《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》和《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》和《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》；上述 7 项会计准则均自

2014 年 7 月 1 日起施行。2014 年 6 月，财政部修订了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本基金的财务报表无重大影响。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 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与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（资产支持证券和私募债券除外），鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

#### 1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转



让，暂免征收印花税。

## 2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金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。

## 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（“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
华宝投资有限公司（“华宝投资”）	受宝钢集团控制的公司
华宝证券有限责任公司（“华宝证券”）	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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	-	-	50,638,976.68	4.39%

##### 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 2015年1月1日至2015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
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	46,099.97	4.39%	76,309.33	3.40%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经

手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。权证交易不计佣金。

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 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,489,544.97	7,472,707.46
其中：支付销售机构的客户维护费	1,092,439.91	1,500,405.52

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,248,257.50	1,245,451.18

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

### 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
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
期初持有的基金份额	1,026,541.76	1,026,541.76
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	780,044.00	-
期末持有的基金份额	246,497.76	1,026,541.76
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.05%	0.11%

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

本报告期末及上年度末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

### 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	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		2014 年 1 月 1 日至 2014 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	154,148,642.40	417,230.45	97,620,388.25	465,172.56

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无在承销期内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（2015 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/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

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
000650	仁和药业	2015 年 6 月 12 日	重大事项停牌	13.39	-	-	879,381	6,723,659.79	11,774,911.59	-
000788	北大医药	2015 年 5 月 25 日	重大事项停牌	20.72	2015 年 7 月 21 日	18.65	193,358	3,378,498.23	4,006,377.76	-
000963	华东医药	2015 年 6 月 26 日	重大事项停牌	71.48	2015 年 8 月 5 日	69.20	161,373	8,520,942.99	11,534,942.04	-
002223	鱼跃医疗	2015 年 6 月 25 日	重大事项停牌	57.75	2015 年 7 月 13 日	60.48	648,963	18,178,329.90	37,477,613.25	-
002589	瑞康医药	2015 年 5 月 21 日	重大事项停牌	93.85	-	-	99,974	4,512,569.81	9,382,559.90	-
300142	沃森生物	2015 年 6 月 15 日	重大事项停牌	37.64	-	-	795,228	20,003,026.13	29,932,381.92	-
600645	中源协和	2015 年 4 月 27 日	重大事项停牌	81.31	-	-	400,000	18,269,796.17	32,524,000.00	-

注：本基金截至 2015 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、金融工具公允价值计量的方法

以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 2、各层次金融工具公允价值

(1) 于 2015 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次的余额为人民币 786,880,874.90 元，属于第二层次的余额为人民币 136,632,786.46 元，无属于第三层次余额。

(2) 于 2014 年 12 月 31 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次的余额为人民币 650,050,133.18 元，属于第二层次的余额为人民币 47,148,268.68 元，无属于第三层次余额。

#### 3、公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，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的公允价值列入第一层次；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，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 31 日起改为采用

中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

#### 4、第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层级公允价值本期未发生变动。

## § 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	923,513,661.36	85.48
	其中：股票	923,513,661.36	85.48
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	154,275,936.09	14.28
7	其他各项资产	2,572,265.53	0.24
8	合计	1,080,361,862.98	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	795,394,123.65	76.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	51,387,839.80	4.91
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	405,116.25	0.04

J	金融业	-	-
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	32,524,000.00	3.11
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	43,802,581.66	4.19
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	923,513,661.36	88.27

### 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	300147	香雪制药	2,861,489	88,133,861.20	8.42
2	002022	科华生物	928,951	39,629,049.66	3.79
3	002223	鱼跃医疗	648,963	37,477,613.25	3.58
4	600594	益佰制药	615,977	35,806,743.01	3.42
5	300015	爱尔眼科	1,098,157	35,426,544.82	3.39
6	002007	华兰生物	736,111	32,602,356.19	3.12
7	600645	中源协和	400,000	32,524,000.00	3.11
8	600276	恒瑞医药	700,086	31,181,830.44	2.98
9	300142	沃森生物	795,228	29,932,381.92	2.86
10	002030	达安基因	664,192	29,423,705.60	2.81

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](http://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	300147	香雪制药	21,572,578.65	2.79
2	000538	云南白药	20,508,273.45	2.65
3	600645	中源协和	18,269,796.17	2.36
4	002223	鱼跃医疗	18,178,329.90	2.35
5	300142	沃森生物	17,914,719.63	2.32
6	002424	贵州百灵	17,154,332.22	2.22
7	600718	东软集团	16,817,958.28	2.18
8	000423	东阿阿胶	16,774,665.96	2.17
9	000650	仁和药业	16,758,901.59	2.17
10	300015	爱尔眼科	16,457,188.59	2.13
11	300049	福瑞股份	15,211,635.74	1.97
12	002007	华兰生物	14,887,391.17	1.93
13	300273	和佳股份	14,278,405.63	1.85
14	300244	迪安诊断	13,719,098.53	1.78
15	600750	江中药业	12,882,129.90	1.67
16	600594	益佰制药	12,764,116.51	1.65
17	300006	莱美药业	12,739,743.81	1.65
18	002589	瑞康医药	11,734,559.23	1.52
19	300246	宝莱特	11,699,222.89	1.51
20	600557	康缘药业	11,668,838.12	1.51

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	300147	香雪制药	60,496,125.19	7.83
2	300244	迪安诊断	27,490,164.43	3.56
3	600521	华海药业	23,799,838.07	3.08
4	600750	江中药业	23,378,537.89	3.02
5	000788	北大医药	22,552,682.55	2.92
6	600420	现代制药	20,981,869.83	2.71
7	600161	天坛生物	20,580,160.00	2.66
8	300009	安科生物	19,336,491.11	2.50
9	600518	康美药业	18,757,566.06	2.43
10	600718	东软集团	18,718,447.20	2.42
11	300049	福瑞股份	18,700,896.81	2.42

12	300142	沃森生物	18,618,345.63	2.41
13	000028	国药一致	18,409,551.34	2.38
14	600976	健民集团	17,291,751.13	2.24
15	600267	海正药业	16,466,790.93	2.13
16	300015	爱尔眼科	15,645,552.08	2.02
17	600422	昆药集团	15,409,105.09	1.99
18	300246	宝莱特	15,225,482.14	1.97
19	600511	国药股份	14,318,538.62	1.85
20	600535	天士力	13,922,691.11	1.80

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	490,067,497.47
卖出股票收入（成交）总额	746,057,047.33

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。

### 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

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。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 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	228,725.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	34,295.42
5	应收申购款	2,309,244.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,572,265.53

### 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

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	002223	鱼跃医疗	37,477,613.25	3.58	重大事项停牌
2	600645	中源协和	32,524,000.00	3.11	重大事项停牌
3	300142	沃森生物	29,932,381.92	2.86	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
17,214	30,267.83	353,766,183.99	67.90%	167,264,302.88	32.10%

### 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	330,133.54	0.0634%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年2月28日）基金份额总额	554,397,242.54
本报告期期初基金份额总额	631,531,070.26
本报告期基金总申购份额	439,993,390.29
减：本报告期基金总赎回份额	550,493,973.68
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	521,030,486.87

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

报告期内，基金管理人、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（2012年2月28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、报告期内基金管理人受稽查或处罚的情况

因公司原基金经理牟旭东被追究“利用非公开信息交易”刑事责任，上海证监局于2014年11月对公司进行了专项检查。公司于2015年1月23日收到了上海证监局下发的《沪证监决【2015】18号-关于华宝兴业基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》。公司已经完成了相关问题的整改，并已向上海证监局上报了专项报告。

#### 2、报告期内，本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、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	
国泰君安	2	369,542,966.69	30.08%	327,009.43	29.62%	-
中投证券	1	154,701,217.81	12.59%	140,840.81	12.76%	-
兴业证券	2	112,216,646.74	9.13%	99,300.21	8.99%	-
广州证券	1	99,999,738.14	8.14%	91,039.95	8.25%	-
方正证券	2	83,914,853.28	6.83%	74,415.67	6.74%	-
宏源证券	2	78,923,365.52	6.42%	71,851.55	6.51%	-
平安证券	1	71,228,569.54	5.80%	64,846.48	5.87%	-
瑞银证券	1	57,811,878.39	4.71%	52,631.35	4.77%	-
国金证券	1	46,917,573.01	3.82%	42,714.92	3.87%	-
中银国际	1	43,456,040.54	3.54%	39,562.48	3.58%	-
中信证券	2	27,265,944.62	2.22%	24,822.97	2.25%	-
华创证券	1	26,822,774.80	2.18%	24,419.96	2.21%	-
银河证券	1	20,061,362.61	1.63%	18,264.18	1.65%	-
东兴证券	1	11,823,662.78	0.96%	10,462.70	0.95%	-
东吴证券	1	11,637,265.15	0.95%	10,594.58	0.96%	-
广发证券	1	5,057,230.55	0.41%	4,604.16	0.42%	-
长城证券	1	3,898,064.00	0.32%	3,548.83	0.32%	-
安信证券	1	3,387,938.84	0.28%	3,084.35	0.28%	-
西藏同信	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-

华泰联合	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
财富里昂	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
中金国际	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	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. 本基金本报告期无新增券商交易单元。

### 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
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

广州证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
西藏同信	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
财富里昂	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-



长江证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金于 2015 年 7 月 22 日发布了《修改华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金基金名称及基金合同的公告》，基金名称变更为“华宝兴业医药生物优选混合型证券投资基金”，基金简称变更为“华宝医药生物混合”并相应修改了《基金合同》中的相关内容。本次变更事项自公告之日起生效，变更事项对本基金投资及投资者无不利影响，本公司已履行相关程序，符合相关法律法规及《基金合同》的规定。

华宝兴业基金管理有限公司  
2015 年 8 月 28 日