

上证180成长交易型开放式指数证券投资基金

[2012] 第一季度报告

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
报告送出日期:2012年4月23日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监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责任。

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2012年4月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核结果不存在虚假记载、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。

本报告书财务资料未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 华宝兴业上证180成长ETF

基金代码 510280

交易方式 交易型开放式

基金合同生效日 2011年8月4日

报告期末基金份额总额 415,754,441.00份

投资目标 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

本基金将股票资产投资策略——采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，通常情况下，本基金根据持有的指数成份股在持有的权重中所占的成分股的买卖数量，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

在因特殊情況(如成份股停牌、流动性不足、法律法规限制等)导致无法获得足够數量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合行业判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素，选择其他股票作为成份股备选成份股，进行替代(同行业股票优先考虑)，以期在规定的限制承受范围内，尽量缩小跟踪误差。

业绩比较基准 上证180成长指数

风险收益特征 本基金为股票型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和现金类基金。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2012年1月1日—2012年3月31日)

1.本期已实现收益 4,794,459.57

2.本期利润 41,581,692.90

3.加权平均基金份额本期利润 0.0767

4.期末基金份额净值 386,376,631.21

5.期末基金份额净值 0.929

3.2 基金净值表现

3.2.1 报告期末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 净值增长率① 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 5.33% 1.44% 5.59% 1.45% -0.26% -0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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較

2011年8月4日至2012年3月31日

华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金历史走势图

华宝兴业上证180成长