

华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金

[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、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，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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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和基金合同。

报告期中财务数据未经审计。

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

2.1 基金基本情况

基金简称：华宝兴业成熟市场动量优选

基金主代码：241002

交易代码：241002

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2011年3月15日

报告期末基金份额总额：102,603,447.87份

投资目标：本基金通过投资于发达市场交易公开上市的股票，追求基金资产长期增值。

投资策略：本基金的投资策略主要分为资产配置策略和单个金融产品选择两个部分，其中，将基金资产在不同成熟市场的股票类资产和债券类资产之间进行配置以追求本基金获取超收益的主要来源。

业绩比较基准：50%MSCI 全球股票指数(此处指全球指数)+50%花旗全球政府债券指数。

风险收益特征：本基金的风险收益特征类似于全球平衡型基金，属于中等预期风险和收益的证券投资基金品种，其预期风险和收益水平高于全球股票基金，高于债券基金和货币市场基金。

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

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

境外投资顾问：境外资产托管人

名称：Lyxor Asset Management S.A.

境外资产托管人：Bank of China(Hong Kong)

注册地址：17 cours Valmy, Tours Societe Generale, 49020 Poitiers, France

办公地址：17 cours Valmy, Tours Societe Generale, 49020 Poitiers, France

3.1 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 -44,739.67

2.本期利润 4,681,394.53

3.加权平均基金份额本期利润 0.0469

4.期末基金份额净值 96,703.798

5.期末基金份额净值 0.943

注：1.本期已实现收益扣除非经常性损益后本期利润为-44,739.67元，其中包含因投资收益变动影响归入损益的利息收入-44,739.67元和费用后的余额，本期利润为本公司实现收益加上本期公允价值变动收益扣除和费用后的余额，本期利润为本公司实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.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，费用影响会导致实际收益水平低于所列数字。

3.2 基金主要表现

3.2.1 本基金报告期内份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

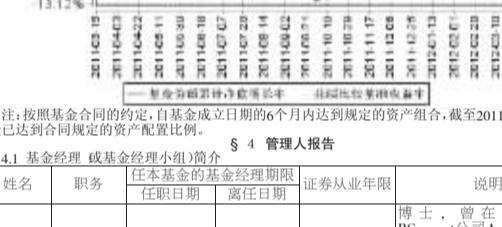
阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个 月 5.84% 0.46% 5.29% 0.41% 0.55% 0.05%

3.2.2 本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较

2011年3月15日至 2012年3月11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，自基金成立之日起6个月内达到规定的资产组合，截至2011年9月15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 基金经理或基金经理小组简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 说明

尤柏金 基金经理/基金经理助理 2011年3月15日 - 9年 博士，曾在澳大利亚B2Connect公司ApeX投资部门从事投资、金融工程模型设计及资源配置工作；2008年1月加入华宝兴业基金管理有限公司任金融工程模型分析师，2008年8月起担任华宝兴业基金管理有限公司分析师，2009年3月至2011年3月任华宝兴业基金管理有限公司债券投资经理，2010年11月至2011年3月任华宝兴业基金管理有限公司基金经理，2011年3月兼任华宝兴业基金管理有限公司基金经理，2012年3月任华宝兴业基金管理有限公司基金经理。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名 在境外投资顾问所任职务 说明

Guillaume Lasserre 领先资产组合管理机构方案部(Dedicated Solutions)部门负责人 8 Guillaume Lasserre 先生于2000年10月出生，现就职于法国领先的资产管理公司，担任组合经理一职，2004年，Lasserre先生的职业生涯开始于一家法国领先的资产管理公司，主要从事投资、金融工程模型设计及资源配置工作，2006年，Lasserre先生开始担任华宝兴业基金管理有限公司基金经理，负责华宝兴业基金管理有限公司的产品设计部分，负责华宝兴业基金管理有限公司基金经理，2011年3月兼任华宝兴业基金管理有限公司基金经理，2012年3月任华宝兴业基金管理有限公司基金经理。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本基金报告期内，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》及其他法律法规、《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，遵循诚实信用、公平对待客户、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。

4.5.1 基金管理人承诺履行诚实守信、勤勉尽责的义务。投资人对基金的投资风险在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

4.5.2 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.3 基金管理人承诺不从事利益输送、不公平交易行为。

4.5.4 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.5 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.6 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.7 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.8 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.9 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.10 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.11 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.12 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.13 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.14 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.15 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.16 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.17 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.18 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.19 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.20 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.21 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.22 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.23 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.24 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.25 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.26 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.27 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.28 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.29 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.30 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.31 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.32 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.33 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.34 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.35 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.36 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.37 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.38 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.39 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.40 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.41 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.42 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.43 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.44 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.45 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.46 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.47 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.48 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.49 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.50 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.51 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.52 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.53 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.54 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.55 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.56 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.57 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.58 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.59 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.60 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.61 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.62 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.63 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.64 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.65 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.66 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.67 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.68 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.69 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.70 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.71 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.72 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.73 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.74 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.75 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.76 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.77 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.78 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.79 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.80 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.81 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.82 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.83 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.84 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.85 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.86 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.87 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.88 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.89 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.90 基金管理人承诺不从事内幕交易、不公平交易行为。

4.5.91 基金管理人承诺