

## 华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金

## [2012] 第二季度报告

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司  
基金托管人:中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期:2012年7月18日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及董事会秘书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定，于2012年7月12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信息，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。

本基金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。

本报告书经财务资料未经审计。

本报告书自2012年4月1日起至6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称 华宝兴业上证180价值ETF

基金主代码 510030

交易代码 510030

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2010年4月23日

报告期末基金份额总额 444,028,726.00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。

投资策略 本基金投资股票的买卖原则采用完全复制法的指数的方法跟踪标的指数，通常情况下，本基金根据标的指数的成份股在指数中的权重确定对应的股票的买卖数量，然后根据股票的买卖量在该股票的买卖量中进行调整，从而达到与标的指数一致的效果。在因特殊原因(如部份股票停牌、流动性不足、法规限制等原因)导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性和因素挑选指数中的其他成份股，备选股票将作为最终的替代品。对于股票而言，本基金可以考虑市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性和因素挑选指数中的其他成份股，备选股票将作为最终的替代品。

业绩比较基准 上证180价格指数

风险收益特征 本基金为股票基金，其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金在股票基金中属于指数基金，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与股票市场水平大致相当的资产。

基金管理人 华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人 中国工商银行股份有限公司

## § 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4月1日 - 2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -25,285,912.10

2.本期利润 5,105,175.58

3.加权平均基金份额本期利润 0.0099

4.期末基金资产净值 1,004,610,750.20

5.期末基金份额净值 1.004 (2.26)

注:1.本期的收入项目包括基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的净额、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所列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。

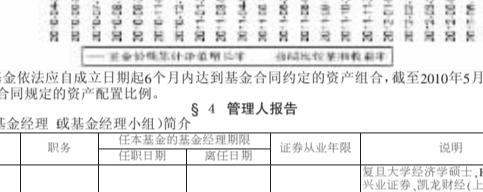
3.基金净值表现

本基金为股票基金，其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金在股票基金中属于指数基金，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与股票市场水平大致相当的资产。

4.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2010年4月23日至2012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:基金依法应自成立之日起6个月内达到基金合同约定的资产组合，截至2010年5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 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 在任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

徐林明 基金经理 2010年4月23日 - 10年

本基金基金经理由华宝兴业基金管理有限公司担任基金经理助理，负责基金的日常管理。2005年9月加入华宝兴业基金管理有限公司，曾任基金金融工程部项目经理，基金金融工程部副总监，2010年4月23日起担任本基金基金经理。

10.2.2 由 ETF 管理、指数基金、量化投资、固定收益、量化投资等部门担任基金经理的基金经理

基金经理

基金经理

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国投资基金法》及其各项实施细则、《上海证券交易所交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律的规定，履行诚实信用、勤勉尽责的职责管理好基金资产，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的利益。

4.3 管理人对报告期内基金运作中出现的问题及采取的纠正措施的说明

4.4 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格执行公平交易制度，不存在不公平交易行为。

4.5 代理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望二季末，国内经济增速下滑，通胀继续回落，银行贷款需求不足，企业盈利下降，货币政策将延续宽裕形势，利率和流动性将逐步恢复正常，投资资金将重新配置到实体经济，企业盈利改善，消费需求增加，股市将逐步回暖，行业表现将相对较好，医药、生物、证券等行业涨幅可能相对较大，而黑色金属、采掘及银行等行业跌幅超逾5%，风格表现差异并不大；沪深300指数和中证500指数的涨幅分别为2.7%和1.5%。

本基金正常运作期间，在操作中，我们严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，

在指数编制方法、应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.6 告知报告期的基金投资策略和运作分析

本报告期内，基金管理人严格执行公平交易制度，定期披露定期报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资基金均在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理环节得到公平对待。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，分析了本基金公司旗下所有其他投资基金组合之间的整体收益差异，分投类别、基金品种、投资策略、投资风格等方面，未发现不公平交易行为。

4.7 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

4.8 投资组合报告附注

5.1 报告期末持有的处于转持期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转持期的可转换债券。

5.2 报告期末指数投资品种占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金报告期末未持有指数投资品种。

5.3 报告期末指数投资品种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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

5.4 报告期末持有的处于转持期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转持期的可转换债券。

5.5 报告期末指数投资品种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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

5.6 报告期末指数投资品种占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金报告期末未持有指数投资品种。

5.7 报告期末持有的处于转持期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有可转换债券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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月内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序特别说明。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 -

2 应收证券清算款 2,436,417.54

3 应收利息 3,754,500.03

4 应收申购款 943.39

5 其他应收款 -

6 其他 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 6,191,860.96

5.8.4 报告期末持有的处于转持期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转持期的可转换债券。

5.8.5 报告期末指数投资品种占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金报告期末未持有指数投资品种。

5.8.6 报告期末指数投资品种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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

5.8.7 报告期末指数投资品种占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金报告期末未持有指数投资品种。

5.8.8 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 -

2 应收证券清算款 -

3 应收利息 -

4 应收申购款 -

5 其他应收款 -

6 其他 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 -

5.8.9 报告期末指数投资品种占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金报告期末未持有指数投资品种。

5.8.10 报告期末指数投资品种占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金报告期末未持有指数投资品种。

5.8.11 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 -

2 应收证券清算款 -

3 应收利息 -

4 应收申购款 -

5 其他应收款 -

6 其他 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 -

5.8.12 报告期末指数投资品种占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金报告期末未持有指数投资品种。

5.8.13 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 -

2 应收证券清算款 -

3 应收利息 -

4 应收申购款 -

5 其他应收款 -

6 其他 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 -

5.8.14 报告期末指数投资品种占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金报告期末未持有指数投资品种。

5.8.15 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 -

2 应收证券清算款 -

3 应收利息 -

4 应收申购款 -

5 其他应收款 -

6 其他 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 -

5.8.16 报告期末指数投资品种占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金报告期末未持有指数投资品种。