

华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【2012】第四季度报告

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:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21日

内出现过持仓的ETF市值占基金资产净值低于90%的情况。发生此类情况后,该基金均在合理期限内得到了调整,没有给投资人带来额外风险或损失。

4.3 公平交易专项说明

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各环节得到公平对待。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,分析了本基金与公司旗下所有其他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,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超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内,PMI持续反弹、发电量增速加快等宏观经济领先指标走势反映出国内宏观经济出现了明显企稳迹象;十八大顺利召开,国家新、老领导人顺利交接,稳定和改革政策预期;同时房地产市场投资恢复、铁路投资和基建投资提速的拉动下,经济出现改善。海外方面:美国经济持续走强,欧债危机也度过了恐慌阶段,海外市场趋于稳定。四季度A股市场的走势先抑后扬,前两个月持续下跌,跌至全年最低点1949点之后,在金融、房地产等周期股带动下,市场强劲反弹,期间沪深300指数和上证180价值指数分别上涨10.02%和9.72%,中证500指数和创业板指数分别上涨2.38%和3.51%,大盘价值股领涨市场。

本报告期内本基金为正常运作期,在操作中,我们严格遵守本基金合同,坚持既定的指数化投资策略,在指数权重调整和基金申赎变动时,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。

4.2 报告期内基金的投资策略

截至本报告期末,本基金份额净值为0.940元,本报告期基金份额净值增长率为18.84%,同期业绩比较基准收益率为16.69%。本报告期内本基金日均跟踪偏离度的绝对值为0.040%,年化跟踪误差为0.89%。

4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,我们认为全球经济形势仍2012年有所好转,美国“财政悬崖”危机化解,经济继续呈现缓慢复苏,欧洲下滑势头有望趋缓。中国经济依靠基建投资、出口好转和低利率而企稳,受益于制度性红利和城镇化进程,投资者对经济前景的预期将逐渐明朗;十八大的胜利召开,政治领导人换届之后的新气象,新作在坚持改革背景下对经济发展将出台更多政策支持,增加投资者对未来经济前景的信心;另外,部分信托和理财产品出现的兑付风险,正在逐步降低投资者的无风险收益率的预期水平,在此背景下,股票资产的相对吸引力正在提高。如宏观经济逐步确定步入复苏期,股票资产无疑是最佳的大类资产配置类别。

作为指数的基金管理人,我们将继续严格遵守基金合同,坚持既定的指数化投资策略,积极应对成分股调整和基金申购赎回,严格控制基金相对目标指数的跟踪误差,实现对上证180价值指数的有效跟踪。

5.1 投资组合报告

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.3 报告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

5.1.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.1.5 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债券投资明细

5.1.6 报告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

5.1.7 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权证投资明细

5.1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

5.1.9 投资组合报告附注

5.1.9.1 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特别提示。

5.1.9.2 本基金本报告期末未持有股票投资。

5.1.9.3 其他资产构成

5.1.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.1.9.5 报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.1.9.6 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.1.9.7 报告期末未持有股票。

5.2 开放式基金资产变动

5.2.1 报告期末基金份额总额

5.2.2 报告期末基金份额总额

5.2.3 报告期末基金份额总额

5.2.4 报告期末基金份额总额

5.2.5 报告期末基金份额总额

5.2.6 报告期末基金份额总额

5.2.7 报告期末基金份额总额

5.2.8 报告期末基金份额总额

5.2.9 报告期末基金份额总额

5.2.10 报告期末基金份额总额

5.2.11 报告期末基金份额总额

5.2.12 报告期末基金份额总额

5.2.13 报告期末基金份额总额

5.2.14 报告期末基金份额总额

5.2.15 报告期末基金份额总额

5.2.16 报告期末基金份额总额

5.2.17 报告期末基金份额总额

5.2.18 报告期末基金份额总额

5.2.19 报告期末基金份额总额

5.2.20 报告期末基金份额总额

5.2.21 报告期末基金份额总额

5.2.22 报告期末基金份额总额

5.2.23 报告期末基金份额总额

5.2.24 报告期末基金份额总额

5.2.25 报告期末基金份额总额

5.2.26 报告期末基金份额总额

5.2.27 报告期末基金份额总额

5.2.28 报告期末基金份额总额

5.2.29 报告期末基金份额总额

5.2.30 报告期末基金份额总额

5.2.31 报告期末基金份额总额

5.2.32 报告期末基金份额总额

5.2.33 报告期末基金份额总额

5.2.34 报告期末基金份额总额

5.2.35 报告期末基金份额总额

5.2.36 报告期末基金份额总额

5.2.37 报告期末基金份额总额

5.2.38 报告期末基金份额总额

5.2.39 报告期末基金份额总额

5.2.40 报告期末基金份额总额

5.2.41 报告期末基金份额总额

5.2.42 报告期末基金份额总额

5.2.43 报告期末基金份额总额

5.2.44 报告期末基金份额总额

5.2.45 报告期末基金份额总额

5.2.46 报告期末基金份额总额

5.2.47 报告期末基金份额总额

5.2.48 报告期末基金份额总额

5.2.49 报告期末基金份额总额

5.2.50 报告期末基金份额总额

5.2.51 报告期末基金份额总额

5.2.52 报告期末基金份额总额

5.2.53 报告期末基金份额总额

5.2.54 报告期末基金份额总额

5.2.55 报告期末基金份额总额

5.2.56 报告期末基金份额总额

5.2.57 报告期末基金份额总额

5.2.58 报告期末基金份额总额

5.2.59 报告期末基金份额总额

5.2.60 报告期末基金份额总额

5.2.61 报告期末基金份额总额

5.2.62 报告期末基金份额总额

5.2.63 报告期末基金份额总额

5.2.64 报告期末基金份额总额

5.2.65 报告期末基金份额总额

5.2.66 报告期末基金份额总额

5.2.67 报告期末基金份额总额

华宝兴业收益增长混合型证券投资基金

【2012】第四季度报告

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21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
报告送出日期:2013年1月21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
报告送出日期:2013年1月21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
报告送出日期:2013年1月21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
报告送出日期:2013年1月21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
报告送出日期:2013年1月21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
报告送出日期:2013年1月21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
报告送出日期:2013年1月21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
报告送出日期:2013年1月21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
报告送出日期:2013年1月21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
报告送出日期:2013年1月21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
报告送出日期:2013年1月21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
报告送出日期:2013年1月21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
报告送出日期:2013年1月21日