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

华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF）

【2012】第四季度报告

§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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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2013年1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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§２ 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	华宝油气
基金主代码	162411
交易代码	162411
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2011年9月29日
报告期末基金份额总额	68,201,292.19份
投资目标	通过严格的指数化投资策略，实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过5%(以美元资产计价)。
投资策略	本基金原则上采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况(如股票停牌、流动性不足)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将使用其他合理方法进行适当的替代，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标的指数相关的公募基金、上市交易型基金，以优化投资组合的建立，达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。
业绩比较基准	标普石油天然气上游股票指数(全收益指数)
风险收益特征	本基金是一只美国股票指数型证券投资基金，风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金，属于预期风险较高的产品。
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

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	–	The Bank of New York Mellon Corporation
	中文	–	纽约梅隆银行
注册地址		–	One Wall Street New York,NY10286
办公地址		–	One Wall Street New York,NY10286
邮政编码		–	NY10286

§３ 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年10月1日 – 2012年12月31日)
1.本期已实现收益	706,416.12
2.本期利润	–2,381,150.15
3.加权平均基金份额本期利润	–0.0340
4.期末基金资产净值	64,538,554.95
5.期末基金份额净值	0.946

注:1.本期已实现收益指基本期利息收入、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。

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

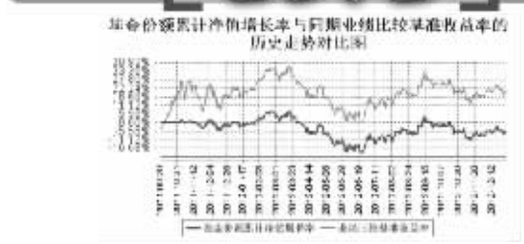
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	–3.57%	1.29%	–3.18%	1.38%	–0.39%	–0.09%

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较

(2011年9月29日 至 2012年12月31日)



注:1、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3月29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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
尤柏年	本基金基金经理、华宝兴业成熟市场QDII基金经理	2011年9月29日	–	9年	博士，曾在澳大利亚BConnect公司Apex投资咨询团队从事投资、金融工程模型开发、资产配置、行业研究等工作。2007年6月加入本公司任金融工程部高级数量分析师，2008年8月起任海外投资部高级分析师，2009年3月至2011年3月任华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金基金经理助理兼任高级分析师，2011年3月至今任华宝兴业成熟市场QDII基金经理，2011年9月兼任华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF)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。

由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化，标普石油天然气上游指数基金在短期内出现过持有的现金与到期日在一年之内的政府债券市值占基金资产净值比低于5%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量超过该证券当日成交量的5%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

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

回顾报告期内本基金相关资产的表现，以人民币计价基准下跌了–3.32%，WTI原油期货价格下跌了–2.51%，标普500指数下跌了–1.81%。油气股票资产相对于美国股票大盘以及原油价格的表现都不好。

从基本面来看，美国油气相关资产在4季度表现不好主要受到了两方面因素的影响。一方面美国大选结果仍然形成了民主党总统，共和党众议院的结果，投资者担心这一局面不利于解决美国面临的财政悬崖以及债务上限的问题。另一方面，由于美国近年来油气页岩项目开发的蓬勃发展，使得美国目前原油生产的水平已经超出了08年金融危机前的水平，而由于目前美国失业率仍然较高，需求仍然低于08年前的水平。供求关系向供给方向的倾斜也造成了今年本基金基准表现低于美国大盘指数的结果。

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–3.57%，同期业绩比较基准增长率为–3.18%，基金表现落后基准0.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下季度，美国油气资产由于供给增长过快，需求维持基本不变的情况下，在过去一年表现不佳，但估值处于较吸引的区间。从美国能源使用的结构来看，交通运输占比最大。随着美国就业形势的改善，油气的需求也会随之增加，因此油气资产也有望在未来的一年内有较好的表现。

§５ 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	59,121,535.34	90.23
	其中:普通股	–	–
	优先股	59,121,535.34	90.23
	存托凭证	–	–
	房地产信托凭证	–	–
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
	其中:远期	–	–
	期货	–	–
	期权	–	–
	权证	–	–
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	货币市场工具	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	6,243,988.80	9.53
8	其他资产	154,362.86	0.24
9	合计	65,519,887.00	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	59,121,535.34	91.61
合计	59,121,535.34	91.61

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1能源	59,121,535.34	91.61
材料	–	–
工业	–	–
非必需消费品	–	–
必需消费品	–	–
保健	–	–
金融	–	–
信息技术	–	–
电信服务	–	–
公用事业	–	–
合计	59,121,535.34	91.61

5.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

5.4.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	CVR ENERGY INC	CVR Energy Inc	CVI US	纽约	美国	3,800	1,165,344.27	1.81
2	EQT CORP	EQT公司	EQT US	纽约	美国	2,695	999,087.14	1.55
3	PDC Energy Inc	PDC Energy Inc	PDCE US	纳斯达克	美国	4,732	987,764.57	1.53
4	OASIS PETROLEUM INC	Oasis Petroleum Inc	OAS US	纽约	美国	4,919	983,204.31	1.52
5	HESS CORP	阿美拉达赫斯	HES US	纽约	美国	2,849	948,375.35	1.47
6	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	Pioneer 自然资源公司	PXD US	纽约	美国	1,412	945,999.68	1.47
7	EXXON MOBIL CORP	艾克森美孚石油	XOM US	纽约	美国	1,731	941,681.35	1.46
8	SOUTHWESTERN ENERGY CO	西南能源公司	SWN US	纽约	美国	4,481	941,003.52	1.46
9	CABOT OIL & GAS CORP	卡伯特石油天然气公司	COG US	纽约	美国	2,976	930,418.93	1.44
10	CHEVRON CORP	雪佛龙德士古	CVX US	纽约	美国	1,363	926,450.14	1.44

5.4.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	899.02
4	应收利息	374.23
5	应收申购款	153,089.61
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	154,362.86

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§６ 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	73,072,981.21
本报告期基金总申购份额	4,482,222.92
减:本报告期基金总赎回份额	9,353,911.94
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	68,201,292.19

注:总申购份额含红利再投资和转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§７ 备查文件目录

7.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;
华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF)基金合同;
华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF)招募说明书;
华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF)托管协议;
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告;
基金托管人业务资格批件和营业执照。

7.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

7.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司
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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:２０１３年１月２１日

华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金

【2012】第四季度报告

§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2013年1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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§２ 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	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	67,069,091.41份
投资目标	本基金通过投资于发达市场交易型开放式基金(ETF)等金融工具，在国际范围内分散投资风险，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策略两个部分，其中，将基金资产在全球成熟金融市场的股票类资产和债券类资产之间进行配置将是本基金获取超额收益的主要来源。
业绩比较基准	50%MSCI 全球指数（此处指全收益指数)+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品种，其预期风险和收益水平低于全球股票型基金，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

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Lyxor Asset Management S.A.	Bank of China(Hong Kong)
	中文	领先资产管理公司	中国银行(香港)有限公司
注册地址		17 cours Valmy,Tours Societe Generale, 92800 Puteaux,France	香港花园道1 号中银大厦
办公地址		17 cours Valmy,Tours Societe Generale, 92800 Puteaux,France	香港花园道1 号中银大厦

§３ 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年10月1日 – 2012年12月31日)
1.本期已实现收益	240,921.78
2.本期利润	–597,641.31
3.加权平均基金份额本期利润	–0.0087
4.期末基金资产净值	62,179,336.17
5.期末基金份额净值	0.927

注:1、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。

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

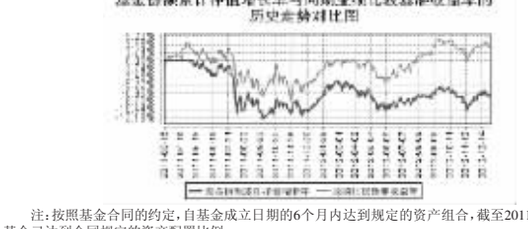
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	–0.86%	0.40%	–0.48%	0.38%	–0.38%	0.02%

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较

(2011年3月15日 至 2012年12月31日)



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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
尤柏年	本基金基金经理、华宝兴业油气基金经理	2011年3月15日	–	9年	博士，曾在澳大利亚BConnect公司Apex投资咨询团队从事投资、金融工程模型开发、资产配置、行业研究等工作。2007年6月加入本公司任金融工程部高级数量分析师，2008年8月起任海外投资部高级分析师，2009年3月至2011年3月任华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金基金经理助理兼任高级分析师，2011年3月至今任华宝兴业成熟市场QDII基金经理，2011年9月起兼任华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)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	证券从业年限	说明
Guillaume Lasserre	领先资产量化多资产组合管理部(Systematic Multi assets portfolio management）副总经理兼机构方案部(Dedicated Solutions)联席负责人	9	Guillaume Lasserre先生于2009年10月加入领先资产的量化多资产团队，担任组合经理一职。2004年，Lasserre先生的职业生涯开始于法兴资产的量化研究员一职，主要负责组合保险策略以及基金权证方面的研究工作。2006年，Lasserre先生作为量化工程师加入法兴资产另类投资的产品设计团队，负责为共同基金以及对冲基金的结构化产品定价。Lasserre先生拥有巴黎第七大学的金融数学博士学位。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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量超过该证券当日成交量的5%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾报告期内本基金相关资产的表现，以人民币计价成熟市场全球股票指数上涨了1.23%，成熟市场债券指数下跌了–2.5%，股票资产的表现相对较好。

从基本面来看，在4季度美国股市围绕着财政悬崖问题的发展面波动较大。表现相对较好的是欧美热钱涌入较多的亚太股市，以人民币计价成熟亚太指数上涨了7.35%，也是表现最好的一类成熟市场资产。

在操作上由于投资顾问动量模型的存在一定的后滞性，并比较强调历史波动率的因素，因此未能在趋势初期把握到亚太股票的上涨趋势，另基金还持有较大比例的美国国债，因此表现相对基准出现了负的偏离。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截止至本报告期末，本报告期内基金份额净值增长率为–0.86%，同期业绩比较基准收益率为–0.48%，基金落后业绩比较基准0.38%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下季度，美国两党将财政悬崖中的财政开支问题在最后关头顺延至了2013年2月，而欧美经济体仍然存在着负债率较高的问题。美国国债由于收益率过低，存在着较大的利率风险。因此我们预期欧美股市的波动将会较大。从基本面因素来看，日本自民党首相的上台将采取量化宽松的方式释放流动性，而2013年也是我国新一届领导人的执政的第一年，因此我们相对看好亚太及日本的股票市场。

§５ 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	–	–
	其中:普通股	–	–
	优先股	–	–
	存托凭证	–	–
	房地产信托凭证	–	–
2	基金投资	39,879,313.44	61.47
3	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
	其中:远期	–	–
	期货	–	–
	期权	–	–
	权证	–	–
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	货币市场工具	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	24,854,013.17	38.31
8	其他资产	144,473.12	0.22
9	合计	64,877,799.73	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.4 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及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	SPDR S&P 500 ETF TRUST	ETF基金	开放式	SSGA Funds Management Inc	8,823,723.18	14.19
2	ISHARES BARCLAYS 7-10 YEAR	ETF基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	7,263,005.25	11.68
3	ISHARES BARCLAYS 3-7 YEAR	ETF基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	7,125,393.65	11.46
4	ISHARES MSCI JAPAN INDEX FD	ETF基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	3,064,181.25	4.93
5	FINANCIAL SELECT SECTOR SPDR	ETF基金	开放式	State Street Bank and Trust Company	2,133,801.54	3.43
6	ENERGY SELECT SECTOR SPDR	ETF基金	开放式	State Street Bank and Trust Company	2,110,469.76	3.39
7	INDUSTRIAL SELECT SECT SPDR	ETF基金	开放式	State Street Bank and Trust Company	2,096,339.96	3.37
8	CONSUMER DISCRETIONARY SELT	ETF基金	开放式	State Street Bank and Trust Company	2,086,848.86	3.36
9	HEALTH CARE SELECT SECTOR	ETF基金	开放式	State Street Bank and Trust Company	2,084,177.52	3.35
10	ISHARES S&P 500 INDEX FUND	ETF基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	1,573,826.35	2.53

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 本基金不投资股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	143,615.25
4	应收利息	163.81
5	应收申购款	694.06
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	144,473.12

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

§６ 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	70,932,923.70
本报告期基金总申购份额	51,845.69
减:本报告期基金总赎回份额	3,915,677.98
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	67,069,091.41

注:总申购份额含红利再投、转换入份额。

§７ 备查文件目录

7.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;
华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金基金合同;
华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金招募说明书;
华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金托管协议;
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告;
基金托管人业务资格批件和营业执照。

7.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

7.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司
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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:２０１３年１月２１日

华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

【2012】第四季度报告

§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2013年1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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§２ 基金产品概况

基金简称	华宝兴业大盘精选股票
基金主代码	240011
交易代码	240011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年10月7日
报告期末基金份额总额	515,411,649.54份
投资目标	在控制风险的前提下，争取基金净值中长期增长超越业绩比较基准。
投资策略	本基金将深入研究大盘股基本面和长期发展前景，注重价值挖掘，通过定量与定性相结合的个股精选策略精选个股，通过对宏观经济、行业经济的把握以及对行业运行周期的认识，调整股票资产在不同行业的投资比例。本基金的大盘股指沪深A股按照流通市值从大至小排名在前 1/3的股票。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的较高风险、较高收益的品种。
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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年10月1日 – 2012年12月31日)
1.本期已实现收益	–9,476,719.46
2.本期利润	33,980,832.47
3.加权平均基金份额本期利润	0.0695
4.期末基金资产净值	688,572,665.84
5.期末基金份额净值	1.3360

注:1、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。

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

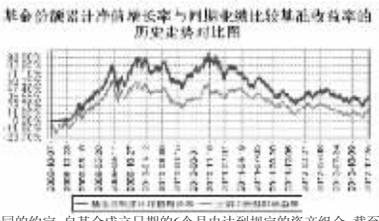
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	4.92%	1.10%	8.18%	1.02%	–3.26%	0.08%

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较

(2008年10月7日 至 2012年12月31日)



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2009年4月7日，本基金已达到基金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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
范红兵	本基金基金经理、华宝兴业医药生物基金经理	2010年7月28日	–	12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月起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。
王智慧	研究部总经理、本基金基金经理、华宝兴业医药生物基金经理	2012年1月19日	–	11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，现任研究部总经理，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。

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，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、《华宝兴业大盘精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 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