华宝兴业可转债债券型证券投资基金

2014 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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月18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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月15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2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业可转债债券
基金主代码	240018
交易代码	240018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月27日
报告期末基金份额总额	323,563,089.28份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下,主要通过对可转债的投资,力争为基金份额持有人创造稳定的当期收益和长期回报。
投资策略	本基金采用自上而下的宏观投资策略,通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求情况,以及证券市场走势、信用风险情况、风险预算和有关法律法规等因素的综合分析,在固定收益类资产和权益类资产之间进行动态灵活配置。本基金将采用定性与定量相结合的方法来构建可转债投资组合,重点投资价值被市场低估、发债公司具有较好发展潜力、基础股票具有较高上升预期的个券品种。
业绩比较基准	中信标普可转债指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金和股票型基金,高于货币市场基金。本基金重点配置可转债,在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§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(2014年4月1日 - 2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-10,444,472.21
2.本期利润	1,254,649.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.0038
4.期末基金资产净值	293,939,236.73
5.期末基金份额净值	0.9084

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。

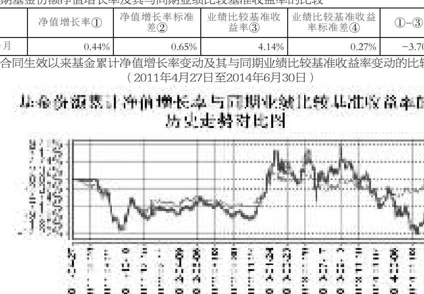
3.2 基金净值表现

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	0.44%	0.65%	4.14%	0.27%	-3.70%	0.38%

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4月27日至2014年6月30日)



注:按照基金合同规定,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10月27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		
王瑞海	固定收益部总经理、本基金基金经理、华宝兴业活期通货币、华宝兴业增强收益债券基金经理	2014年5月16日	-	19年	硕士。曾在深圳中大投资管理公司、海南证券北京营业部、太平人寿保险有限公司、太平资产管理有限公司从事投资管理、股票自营和固定收益投资研究工作。2012年7月加入华宝兴业基金管理有限公司,任固定收益部总经理。2013年4月起兼任华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理,2014年2月至2014年5月任华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金基金经理,2014年5月兼任华宝兴业活期通货币市场基金(由短融50基金转型)基金经理,2014年5月兼任华宝兴业可转债债券型证券投资基金基金经理。
华志贵	本基金基金经理	2011年4月27日	2014年5月16日	10年	硕士。1999年7月至2000年8月在上海广电股份有限公司从事技术、市场工作,2004年5月至2008年7月在上海东方证券股份有限公司从事证券投资工作,2008年8月至2009年9月在中欧基金管理有限公司从事证券投资工作。2009年9月加入华宝兴业基金管理有限公司先后任高级分析师、华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理助理、华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理助理,2010年6月至2011年11月任华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理,2010年6月至2013年4月任华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理,2011年4月至2014年5月任华宝兴业可转债债券型证券投资基金基金经理。

注:1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

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、《华宝兴业可转债债券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,分析了本公司旗下所有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

二季度,转债总体上涨,进入五月中旬以后,以银行转债为代表的大盘转债表现良好,特别是折价较多,到期收益率较高,从债券投资的角度有很高安全垫的品种涨幅可观。

在此期间,努力调整组合的结构,本季度前期在调整结构的过程中适当地降低了杠杆比率。在后期,根据市场的实际情况,有针对性地增加了安全性较高的品种,提高了杠杆。

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0.44%,同期业绩比较基准收益率为4.14%,基金表现落后业绩基准3.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

五月中旬以来资金持续宽松,央行公开市场操作较为灵活,从六月份开始始终是净投放。 在稳增长的大环境下,央行会呵护货币市场,这从多次定向降准可以看出。 五月份财政存款增量低于预期,稳增长背景下加大财政支出力度是主要原因,未来这也是资金宽松的原因之一。整体上来说,资本市场波动幅度会下降。

由于大的投资环境比较宽松,市场的风险偏好会逐渐上升,作为兼具股票和债券性质的可转债,由于有债券的持有收益,同时会在股票上涨时有超额收益,在宽松的投资环境下对一些投资者的吸引力会加大。继续进行结构调整,同时会在相应的时机继续加大杠杆。

§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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	382,846,124.12	98.33
	其中:债券	382,846,124.12	98.33
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	2,282,919.03	0.59
7	其他资产	4,223,528.50	1.08
8	合计	389,352,571.65	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,008.00	0.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	17,018,700.00	5.79
	其中:政策性金融债	17,018,700.00	5.79
4	企业债券	2,008.20	0.00
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	365,824,407.92	124.46
8	其他	-	-
9	合计	382,846,124.12	130.25

5.5 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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110022	同仁转债	626,110	71,614,461.80	24.36
2	113003	重工转债	400,000	45,424,000.00	15.45
3	110015	石化转债	380,000	41,028,600.00	13.96
4	127001	海直转债	254,222	32,940,815.65	11.21
5	113005	平安转债	287,000	30,657,340.00	10.43

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

石化转债发行人中国石化2014 年1 月13 日发布公告:国务院对山东省青岛市"11?22"中石化东黄输油管道泄漏爆炸特别重大事故调查处理报告已作出批复,同意国务院事故调查组的调查处理结果,对中国石化及当地政府的48名责任人分别给予纪律处分,对涉嫌犯罪的15名责任人移送司法机关依法追究法律责任。根据国务院事故调查组的统计,本次事故造成直接经济损失人民币75,172万元,公司将承担其相应赔偿责任。

平安转债发行人中国平安2013年10月14日公告其控股子公司平安证券有限责任公司(以下简称"平安证券")近日收到《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》((2013)48号)。中国证券监督管理委员会决定责令平安证券改正及给予警告,没收其在万福生科(湖南)农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元,并处以人民币5,110万元的罚款,暂停其保荐业务许可3个月。

民生转债发行人中国民生银行股份有限公司2013年9月25日收到交易商协会自律处分。处罚原因是江苏汇鸿国际集团有限公司作为相关债务融资工具发行人,在债务融资工具存续期间,未合规披露子公司中融信佳对外担保信息。主承销商中信银行、民生银行、广发银行在尽职调查中未将中融信佳对外担保情况作为或有事项进行专项了解,亦未辅导企业在募集说明书中披露上述情况。根据相关自律规定,经交易商协会秘书处专题办公会审议决定,给予主承销商中信银行、民生银行、广发银行诫勉谈话处分,并处责令改正。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析,认为该处罚不会对公司的投资价值构成实质性影响,因此本基金管理人对上述可转债的投资判断未发生改变。本报告期内,本基金投资的前十名证券的其余七名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.10.2

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	342,637.01
2	应收证券清算款	2,154,502.11
3	应收股利	-
4	应收利息	1,707,436.85
5	应收申购款	18,952.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,223,528.50

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110022	同仁转债	71,614,461.80	24.36
2	113003	重工转债	45,424,000.00	15.45
3	110015	石化转债	41,028,600.00	13.96
4	127001	海直转债	32,940,815.65	11.21
5	113005	平安转债	30,657,340.00	10.43
6	110023	民生转债	29,974,400.00	10.20
7	128002	东华转债	20,595,600.00	7.01
8	113002	工行转债	16,232,654.00	5.52
9	110011	歌华转债	13,559,575.00	4.61
10	128003	华天转债	12,214,722.15	4.16
11	110020	南山转债	7,379,856.00	2.51
12	110024	隧道转债	6,581,900.00	2.24
13	110017	中海转债	5,206,384.00	1.77
14	127002	徐工转债	4,456,571.13	1.52
15	113001	中行转债	3,053,700.00	1.04
16	125887	中鼎转债	1,064,188.19	0.36

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	330,498,586.34
报告期期间基金总申购份额	1,204,947.65
减:报告期期间基金总赎回份额	8,140,444.71
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	323,563,089.28

注:总申购份额含转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	448,697.83
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	448,697.83
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.14

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;

华宝兴业可转债债券型证券投资基金基金合同;

华宝兴业可转债债券型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业可转债债券型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。

8.2 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。

8.3 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
2014年7月18日

上证180成长交易型开放式指数证券投资基金

2014 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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月18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2014年7月15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2014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成长ETF
基金主代码	510280
交易代码	510280
基金运作方式	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	275,754,441.00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。
投资策略	本基金股票资产投资原则上采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数。通常情况下,本基金根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在因特殊情况(如成份股停牌、流动性不足、法规法律限制等)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、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代(同行业股票优先考虑),以期在规定的风险承受限度之内,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、债券型基金和混合基金。
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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年4月1日 - 2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-8,626,500.35
2.本期利润	2,208,171.83
3.加权平均基金份额本期利润	0.0079
4.期末基金资产净值	242,763,828.67
5.期末基金份额净值	0.880

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。

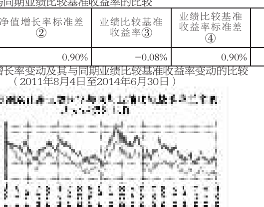
3.2 基金净值表现

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	0.92%	0.90%	-0.08%	0.90%	1.00%	0.00%

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8月4日至2014年6月30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2012年2月4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		
胡洁	本基金基金经理、华宝兴业上证180成长ETF联接基金经理	2012年10月16日	-	8年	硕士。2006年6月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后在交易部、产品开发部和量化投资部工作,2012年10月起任华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

注:1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、基金管理人于2014年1月29日发布公告,本基金基金经理胡洁女士因个人原因(休产假)在2014年2月10日至2014年6月19日期间无法正常履行职务,由华宝兴业中证100指数型证券投资基金基金经理陈建华先生代为管理本基金。

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、《华宝兴业上证180成长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。

由于成分股调整,上证180成长交易型开放式指数证券投资基金在短期内出现过持有不属于上证180成长指数成分股及其备选成分股的情况以及持有指数成分股及其备选成分股占基金资产净值比例低于95%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,分析了本公司旗下所有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

2014年二季度A股市场整体呈现震荡平稳略有反弹的格局。进入二季度,在海外成长股调整、对经济下滑担忧以及大小盘估值差距回归要求等影响下,市场经历了一波下跌调整行情。延续一季度末下跌走势,创业板继续趋势性下跌,一路跌至1200点,同时上证指数再次跌破2000 点,调整至5月底结束。之后,在稳增长刺激政策继续出台推动经济企稳回升、市场流动性环境改善、IPO发行节奏低于市场预期、IPO重启后炒新带动二级市场同类股票活跃等背景下,股市逐步企稳反弹,市场再度上行。流动性方面,进入二季度后,央行连续两次定向降准,货币环境保持宽松。指数方面,虽然二季度市场整体面临震荡调整,但市场表现仍然分化明显,中小盘指数表现仍强于大盘蓝筹指数。本报告期内,上证180成长指数下跌0.08%,沪深300指数微涨0.88%,而创业板指数和中小板指数分别上涨了5.79%和4.35%。

本报告期本基金为正常运作期,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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为0.880元,本报告期内基金份额净值增长率为0.92%,同期业绩比较基准增长率为-0.08%。本报告期内本基金的日均跟踪偏离度为0.051%,年化跟踪误差为1.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,海外市场,美国就业市场的加速改善带动多项经济数据回升,美联储缓慢退出QE,市场加息预期弱化,国债收益率走低。美国经济增长和国债收益率回落促使美股在二季度强劲反弹,预计下一季度欧美发达经济体将继续稳步复苏,欧美证券市场继续上涨。国内市场,目前新股发行节奏趋缓,新股开闸对市场的压力将逐步回归正常。随着二季度连续两次定向降准和央行货币政策的延续,货币市场利率低位缓升,预计下一季度市场流动性仍会保持宽松。三季度中报披露在即,创业板和中小板或将面临中报不达预期、盈利预期修整、IPO积累效应下存在估值修整等压力,而经过前期调整的大盘蓝筹指数上证180成长的估值目前处于历史底部区域,投资者应该重点关注低估值的上证180成长大盘蓝筹指数带来的投资机会。

作为指数基金的管理人,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成长指数的有效跟踪。

§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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	240,932,212.98	99.00
	其中:股票	240,932,212.98	99.00
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	2,433,416.05	1.00
7	其他资产	921.43	0.00
8	合计	243,366,550.46	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,328,859.00	0.55
B	采矿业	5,811,560.59	2.39
C	制造业	67,511,237.23	27.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,766,853.04	4.02
E	建筑业	1,585,403.00	0.65
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,142,169.14	2.94
J	金融业	129,564,963.98	53.37
K	房地产业	16,209,837.00	6.68
L	租赁和商务服务业	1,493,408.00	0.62
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	485,682.00	0.20
S	综合	-	-
	合计	240,899,972.98	99.23

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	32,240.00	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	32,240.00	0.01

5.3 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

5.3.1 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股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	2,420,300	24,783,872.00	10.21
2	600016	民生银行	3,935,444	24,439,107.24	10.07
3	601166	兴业银行	1,762,600	17,678,878.00	7.28
4	600000	浦发银行	1,725,700	15,617,585.00	6.43
5	601288	农业银行	4,004,700	10,091,844.00	4.16
6	600519	贵州茅台	70,050	9,945,699.00	4.10
7	601328	交通银行	2,421,000	9,393,480.00	3.87
8	600887	伊利股份	251,776	8,338,821.12	3.43
9	600104	上汽集团	509,700	7,798,410.00	3.21
10	601818	光大银行	3,069,431	7,796,354.74	3.21

5.3.2 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股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603369	今世缘	1,000	16,930.00	0.01
2	603328	依顿电子	1,000	15,310.00	0.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.5 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

2013年9月25日中国民生银行股份有限公司收到交易商协会自律处分。处罚原因是江苏汇鸿国际集团有限公司作为相关债务融资工具发行人,在债务融资工具存续期间,未合规披露子公司中融信佳对外担保信息。主承销商中信银行、民生银行、广发银行在尽职调查中未将中融信佳对外担保情况作为或有事项进行专项了解,亦未辅导企业在募集说明书中披露上述情况。根据相关自律规定,经交易商协会秘书处专题办公会审议决定,给予主承销商中信银行、民生银行、广发银行诫勉谈话处分,并处责令改正。

2013年9月25日中国农业银行股份有限公司因其作为债务融资工具主承销商,近期涉及未按规定开展后续管理工作、未合规履行持有人会议有关职责以及未按业务规范要求开展尽职调查等多项违反自律规则指引的情形,根据相关自律规定,经交易商协会秘书处专题办公会审议决定,给予农业银行通报批评处分,并处责令改正。

2013年11月13日招商银行股份有限公司收到交易商协会自律处分。处罚原因是林州重机集团股份有限公司作为债务融资工具发行人,在债务融资工具存续期间,因减资事项涉及重大事项信息披露延迟及持有人会议延迟召开等情形。主承销商招商银行、中信银行在后续管理工作中未充分尽职履责。根据相关自律规定,经交易商协会秘书处专题办公会审议决定,给予主承销商中信银行、招商银行诫勉谈话处分,并处责令改正。

本基金为交易型开放式指数证券投资基金,采用完全复制法进行指数化投资,按照成份股在上证180成长指数中的基准权重构建指数化投资组合。基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

报告期内,本基金投资的前十名证券的其余七名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	445.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	475.62
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	921.43

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603369	今世缘	16,930.00	0.01	新股锁定
2	603328	依顿电子	15,310.00	0.01	新股锁定

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	276,754,441.00
报告期期间基金总申购份额	2,000,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	3,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	275,754,441.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;

华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同;

华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金招募说明书;

华宝兴业上证180成长交易型开放式指数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。

8.2 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。

8.3 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
2014年7月18日

华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2014 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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月18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2014年7月15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2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

基金简称	华宝兴业上证180成长ETF联接
基金主代码	240019
交易代码	240019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年8月9日
报告期末基金份额总额	149,541,501.89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	本基金为目标ETF的联接基金,主要通过投资于目标ETF以达到投资目标。当本基金申购赎回和买卖目标ETF,或基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,本管理人会在10个交易日内对投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。本基金对标的指数的跟踪目标是:在正常情况下,本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。
业绩比较基准	95%×上证180成长指数收益率+5%×银行同业存款利率
风险收益特征	本基金为ETF联接基金,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,属于股票基金中风险较高、收益与标的指数所代表的股票市场水平大致相近的产品。
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华宝兴业上证180成长ETF
基金主代码	510280
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年8月4日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011年10月18日
基金管理人名称	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

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	本基金股票资产投资原则上采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数。通常情况下,本基金根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在因特殊情况(如成份股停牌、流动性不足、法规法律限制等)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、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代(同行业股票优先考虑),以期在规定的风险承受限度之内,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、债券型基金和混合基金。

§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(2014年4月1日 - 2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-374,489.49
2.本期利润	980,798.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.0066
4.期末基金资产净值	135,998,973.91
5.期末基金份额净值	0.909

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。

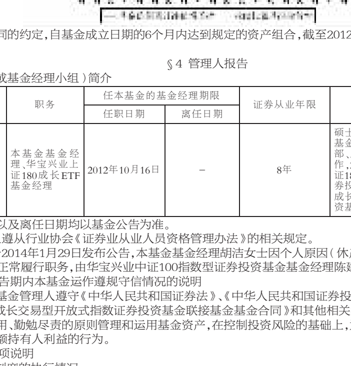
3.2 基金净值表现

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	0.78%	0.86%	-0.05%	0.85%	0.83%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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8月9日至2014年6月30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2012年2月9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		
胡洁	本基金基金经理、华宝兴业上证180成长ETF基金经理	2012年10月16日	-	8年	硕士。2006年6月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后在交易部、产品开发部和量化投资部工作,2012年10月起任华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

注:1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、基金管理人于2014年1月29日发布公告,本基金基金经理胡洁女士因个人原因(休产假)在2014年2月10日至2014年6月19日期间无法正常履行职务,由华宝兴业中证100指数型证券投资基金基金经理陈建华先生代为管理本基金。

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、《华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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,分析了本公司旗下所有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

2014年二季度A股市场整体呈现震荡平稳略有反弹的格局。进入二季度,在海外成长股调整、对经济下滑担忧以及大小盘估值差距回归要求等影响下,市场经历了一波下跌调整行情。延续一季度末下跌走势,创业板继续趋势性下跌,一路跌至1200点,同时上证指数再次跌破2000 点,调整至5月底结束。之后,在稳增长刺激政策继续出台推动经济企稳回升、市场流动性环境改善、IPO发行节奏低于市场预期、IPO重启后炒新带动二级市场同类股票活跃等背景下,股市逐步企稳反弹,市场再度上行。流动性方面,进入二季度后,央行连续两次定向降准,货币环境保持宽松。指数方面,虽然二季度市场整体面临震荡调整,但市场表现仍然分化明显,中小盘指数表现仍强于大盘蓝筹指数。本报告期内,上证180成长指数下跌0.08%,沪深300指数微涨0.88%,而创业板指数和中小板指数分别上涨了5.79%和4.35%。

本报告期本基金为正常运作期,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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为0.909元,本报告期内基金份额净值增长率为0.78%,同期业绩比较基准增长率为-0.05%。本报告期内本基金的日均跟踪偏离度为0.057%,年化跟踪误差为1.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,海外市场,美国就业市场的加速改善带动多项经济数据回升,美联储缓慢退出QE,市场加息预期弱化,国债收益率走低。美国经济增长和国债收益率回落促使美股在二季度强劲反弹,预计下一季度欧美发达经济体将继续稳步复苏,欧美证券市场继续上涨。国内市场,目前新股发行节奏趋缓,新股开闸对市场的压力将逐步回归正常。随着二季度连续两次定向降准和央行货币政策的延续,货币市场利率低位缓升,预计下一季度市场流动性仍会保持宽松。三季度中报披露在即,创业板和中小板或将面临中报不达预期、盈利预期修整、IPO积累效应下存在估值修整等压力,而经过前期调整的大盘蓝筹指数上证180成长的估值目前处于历史底部区域,投资者应该重点关注低估值的上证180成长大盘蓝筹指数带来的投资机会。

作为指数基金的管理人,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成长指数的有效跟踪。

§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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,542,388.40	1.86
	其中:股票	2,542,388.40	1.86
2	基金投资	126,579,627.68	92.80
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,247,326.20	5.31
8	其他资产	38,392.50	0.03
9	合计	136,407,734.78	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	14,931.00	0.01
B	采矿业	65,814.00	0.05
C	制造业	664,657.80	0.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	104,009.40	0.08
E	建筑业	17,193.00	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	81,498.00	0.06
J	金融业	1,394,962.20	1.03
K	房地产业	175,518.00	0.13
L	租赁和商务服务业	19,824.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,981.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,542,388.40	1.87

5.3 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	26,100	267,264.00	0.20
2	600016	民生银行	42,120	261,565.20	0.19
3	601166	兴业银行	18,900	189,567.00	0.14
4	600000	浦发银行	18,600	168,330.00	0.12
5	601288	农业银行	42,900	108,108.00	0.08
6	601328	交通银行	26,100	101,268.00	0.07
7	600519	贵州茅台	660	93,706.80	0.07
8	600887	伊利股份	2,700	89,424.00	0.07
9	601818	光大银行	33,000	83,820.00	0.06
10	600104	上汽集团	5,400	82,620.00	0.06

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.5 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

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	上证180成长ETF	指数型	交易型开放式	华宝兴业基金管理有限公司	126,579,627.68	93.07

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

5.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1

2013年9月25日中国民生银行股份有限公司收到交易商协会自律处分。处罚原因是江苏汇鸿国际集团有限公司作为相关债务融资工具发行人,在债务融资工具存续期间,未合规披露子公司中融信佳对外担保信息。主承销商中信银行、民生银行、广发银行在尽职调查中未将中融信佳对外担保情况作为或有事项进行专项了解,亦未辅导企业在募集说明书中披露上述情况。根据相关自律规定,经交易商协会秘书处专题办公会审议决定,给予主承销商中信银行、民生银行、广发银行诫勉谈话处分,并处责令改正。

2013年9月25日中国农业银行股份有限公司因其作为债务融资工具主承销商,近期涉及未按规定开展后续管理工作、未合规履行持有人会议有关职责以及未按业务规范要求开展尽职调查等多项违反自律规则指引的情形,根据相关自律规定,经交易商协会秘书处专题办公会审议决定,给予农业银行通报批评处分,并处责令改正。

2013年11月13日招商银行股份有限公司收到交易商协会自律处分。处罚原因是林州重机集团股份有限公司作为债务融资工具发行人,在债务融资工具存续期间,因减资事项涉及重大事项信息披露延迟及持有人会议延迟召开等情形。主承销商招商银行、中信银行在后续管理工作中未充分尽职履责。根据相关自律规定,经交易商协会秘书处专题办公会审议决定,给予主承销商中信银行、招商银行诫勉谈话处分,并处责令改正。

本基金是目标ETF的联接基金,为开放式指数基金,股票部分采用完全复制法进行指数化投资,按照成份股在上证180成长指数中的基准权重构建指数化投资组合。基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

报告期内,本基金投资的前十名证券的其余七名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.12.2

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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,951.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,494.84
5	应收申购款	31,946.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,392.50

5.12.4 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。

5.12.5 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	146,321,144.18
报告期期间基金总申购份额	8,798,606.82
减:报告期期间基金总赎回份额	5,578,249.11
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	149,541,501.89

注:总申购份额含转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	659,930.17
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	659,930.17
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.44

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;

华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同;

华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书;

华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议;

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。

8.2 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。

8.3 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
2014年7月18日