

华宝兴业动力组合股票型证券投资基金

[2011] 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:2011年7月6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、完整性和及时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2011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，保证复核结果不存在虚假记载、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本基金资产，但不保证本基金一定盈利。

本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2011年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:华宝兴业动力组合股票

基金主代码:240004

交易代码:240004

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2005年11月17日

报告期末基金份额总额:2,390,680,258.58份

投资目标:通过对基金组合的动态优化管理，使基金收益持续稳定超越基准，并追求单位风险所获得的超额收益最大化。

投资策略:本基金根据中国股市价值驱动因子与成长驱动因子的权重比例，通过在不同风格下精选个股，获取超额收益。

业绩比较基准:80%×上证180指数收益率+基准100指数收益率的流通市值加权平均数+20%×上证180指数收益率。

风险收益特征:本基金是一只积极型股票型投资基金，属于证券投资基金中的较高风险品种。

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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2011年4月1日-2011年6月30日)

1.本期已实现收益 -28,821,628.58

2.本期利润 -122,599,793.31

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0509

4.期末基金份额净值 2,078,477,288.98

5.期末基金份额净值 0.8695

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

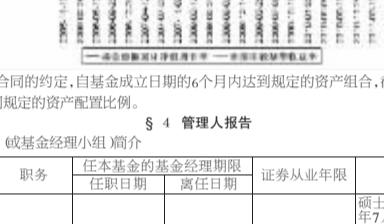
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(%) 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 -5.57% 0.76% -4.29% 0.88% -1.28% -0.12%

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

(2005年11月14日至2011年6月30日)



注:按照基金合同约定,自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合,截至2006年3月31日,本基金已达至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 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

刘自强 宝康消费品基金动力组合股票基金经理 2008年3月19日 - 10年

硕士,2001年7月至2003年7月,在同花顺软件研究员;2003年7月至2003年11月,在华宝兴业基金管理有限公司任行业研究员;2003年11月至2008年3月,在华宝兴业基金管理有限公司任行业研究员;2008年3月至至今任华宝兴业动力组合股票型证券投资经理;2010年6月至2011年6月任华宝兴业动力组合股票型证券投资经理;2011年6月至今任华宝兴业基金管理有限公司基金经理。

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》及其各项实施细则、《华宝兴业动力组合开放式证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定,严格遵守基金合同,基金托管人未发现基金管理人存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立,每日交易日结束报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本基金报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度,加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析,并定期向公司董事会报告。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金报告期内,基金管理人未持有其他基金没有与本基金的投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内,基金管理人未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金管理人的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金管理人的投资策略和运作分析

本基金报告期内,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立,每日交易日结束报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本基金报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度,加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析,并定期向公司董事会报告。

4.4.2 报告期内基金管理人的投资组合情况

本基金报告期内,基金管理人未发现异常交易行为。

4.4.3 报告期内基金管理人的投资策略和业绩表现的说明

本基金报告期内,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立,每日交易日结束报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本基金报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度,加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析,并定期向公司董事会报告。

4.4.4 报告期内基金管理人的投资组合情况

本基金报告期内,基金管理人未发现异常交易行为。

4.4.5 报告期内基金管理人的投资策略和运作分析

本基金报告期内,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立,每日交易日结束报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本基金报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度,加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析,并定期向公司董事会报告。

4.4.6 报告期内基金管理人的投资组合情况

本基金报告期内,基金管理人未发现异常交易行为。

4.4.7 报告期内基金管理人的投资策略和运作分析

本基金报告期内,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立,每日交易日结束报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本基金报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度,加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析,并定期向公司董事会报告。

4.4.8 报告期内基金管理人的投资组合情况

本基金报告期内,基金管理人未发现异常交易行为。

4.4.9 报告期内基金管理人的投资策略和运作分析

本基金报告期内,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立,每日交易日结束报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本基金报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度,加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析,并定期向公司董事会报告。

4.4.10 报告期内基金管理人的投资组合情况

本基金报告期内,基金管理人未发现异常交易行为。

4.4.11 报告期内基金管理人的投资策略和运作分析

本基金报告期内,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立,每日交易日结束报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本基金报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度,加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析,并定期向公司董事会报告。

4.4.12 报告期内基金管理人的投资组合情况

本基金报告期内,基金管理人未发现异常交易行为。

4.4.13 报告期内基金管理人的投资策略和运作分析

本基金报告期内,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立,每日交易日结束报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本基金报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度,加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析,并定期向公司董事会报告。

4.4.14 报告期内基金管理人的投资组合情况

本基金报告期内,基金管理人未发现异常交易行为。

4.4.15 报告期内基金管理人的投资策略和运作分析

本基金报告期内,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立,每日交易日结束报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本基金报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度,加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析,并定期向公司董事会报告。

4.4.16 报告期内基金管理人的投资组合情况

本基金报告期内,基金管理人未发现异常交易行为。

4.4.17 报告期内基金管理人的投资策略和运作分析

本基金报告期内,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立,每日交易日结束报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本基金报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度,加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析,并定期向公司董事会报告。

4.4.18 报告期内基金管理人的投资组合情况

本基金报告期内,基金管理人未发现异常交易行为。

4.4.19 报告期内基金管理人的投资策略和运作分析

本基金报告期内,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立,每日交易日结束报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本基金报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度,加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析,并定期向公司董事会报告。

4.4.20 报告期内基金管理人的投资组合情况

本基金报告期内,基金管理人未发现异常交易行为。

4.4.21 报告期内基金管理人的投资策略和运作分析

本基金报告期内,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立,每日交易日结束报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本基金报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度,加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析,并定期向公司董事会报告。

4.4.22 报告期内基金管理人的投资组合情况

本基金报告期内,基金管理人未发现异常交易行为。

4.4.23 报告期内基金管理人的投资策略和运作分析

本基金报告期内,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立,每日交易日结束报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本基金报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度,加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析,并定期向公司董事会报告。

4.4.24 报告期内基金管理人的投资组合情况

本基金报告期内,基金管理人未发现异常交易行为。

4.4.25 报告期内基金管理人的投资策略和运作分析

本基金报告期内,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立,每日交易日结束报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本基金报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度,加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析,并定期向公司董事会报告。

4.4.26 报告期内基金管理人的投资组合情况

本基金报告期内,基金管理人未发现异常交易行为。

4.4.27 报告期内基金管理人的投资策略和运作分析

本基金报告期内,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立,每日交易日结束报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本基金报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度,加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析,并定期向公司董事会报告。

4.4.28 报告期内基金管理人的投资组合情况

本基金报告期内,基金管理人未发现异常交易行为。

4.4.29 报告期内基金管理人的投资策略和运作分析

本基金报告期内,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立,每日交易日结束报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本基金报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度,加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析,并定期向公司董事会报告。

4.4.30 报告期内基金管理人的投资组合情况

本基金报告期内,基金管理人未发现异常交易行为。

4.4.31 报告期内基金管理人的投资策略和运作分析

本基金报告期内,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立,每日交易日结束报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本基金报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度,加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析,并定期向公司董事会报告。

4.4.32 报告期内基金管理人的投资组合情况

本基金报告期内,基金管理人未发现异常交易行为。

4.4.33 报告期内基金管理人的投资策略和运作分析

本基金报告期内,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立,每日交易日结束报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本基金报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度,加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析,并定期向公司董事会报告。

4.4.34 报告期内基金管理人的投资组合情况

本基金报告期内,基金管理人未发现异常交易行为。

4.4.35 报告期内基金管理人的投资策略和运作分析

本基金报告期内,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立,每日交易日结束报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本基金报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度,加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析,并定期向公司董事会报告。

4.4.36 报告期内基金管理人的投资组合情况

本基金报告期内,基金管理人未发现异常交易行为。

4.4.37 报告期内基金管理人的投资策略和运作分析

本基金报告期内,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立,每日交易日结束报告等