

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  
送出日期:2012年3月29日

§ 1 重要提示及目录

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年3月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要自年度报告公告之日起有效,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。

本报告期自2011年01月01日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金

基金简称 华宝兴业上证180价值ETF

基金代码 510030

交易场所 交易所型开放式

基金合同生效日 2010年4月23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

报告期末基金份额总额 323,528,726.00份

基金资产净值 上市停牌

报告期末总资产 2010年5月28日

2.2 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。

本基金将股票投资原则上采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数,并根据标的指数成份股的构成比例及其权重,确定标的指数成份股的买卖数量,并根据标的指数成份股的构成比例及其权重的变动情况对投资组合进行相应调整。在因特殊原因(如成份股停牌、流动性不足、法规限制等)导致无法按照标的指数成份股的构成比例进行投资时,将根据成份股的流动性等因素挑选出的指数中其他成分股或构造成份股进行替代(同时股票应优先考虑),以期在规定的风险承受限度之内,尽量减小跟踪误差。

业绩比较基准 上证180价值指数

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,风险收益特征与标的指数所代表的股票市场水平大致相近的资产。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

名称 华宝兴业基金管理有限公司 中国工商银行股份有限公司

姓名 赵新华 赵会军

信息披露负责人 联系电话 021-38505888 010-66105799

电子邮件 xpl@efund.com custody@ebc.com.cn

客户服务电话 400-700-5588 021-38924558 95588

传真 021-38505777 010-66105798

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露平台名称 中国证券报、上海证券报、证券时报

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 www.efund.com

本基金年报置备地包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所

基金年度报告置备地点 本公司办公场所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标 2011年 2010年4月23日至2010年12月31日 2009年

本期实现收益 -103,133,563.23 -150,392,143.47 -

本期利润 -250,661,327.74 -204,652,555.79 -

加权平均基金份额利润 -0.4675 -0.3597 -

本期份额平均净值利润率 -18.82% -13.74% -

本期份额净值增长率 -14.84% -12.56% -

3.1.2 期间数据和指标 2011年末 2010年末 2009年末

期末可供分配利润 -390,420,364.30 -159,546,582.02 -

期末可供分配基金份额利润 -0.7457 -0.3676 -

期末基金资产净值 1,138,906,406.61 1,108,333,693.01 -

期末基金份额净值 2.175 2.554 -

3.1.3 基金期末数据 2011年末 2010年末 2009年末

基金总资产净值增长率 -25.54% -12.56% -

注:1. 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,以计算费用后实际收益水平予以列示。

2. 本期已实现收益指基金本期利润收入、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。

3. 期末可供分配利润采用期末资产负资产表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4. 净值相关数据计算中涉及天数的,包括所有交易日以及季末最后一自然日(如非交易日)。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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 份额净值增长率(%) 份额净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 基金资产净值标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -1.41% 1.31% -1.07% 1.29% -0.34% 0.02%

过去六个月 -15.99% 1.34% -15.66% 1.33% -0.33% 0.01%

过去一年 -14.84% 1.28% -15.76% 1.27% 0.92% 0.01%

自基金合同生效日起至今 -25.54% 1.45% -25.10% 1.45% -0.44% 0.00%

注:净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的,包括所有交易日以及季末最后自然日(如非交易日)。

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变动的比较

基金净值走势图

注:基金依法应自成立日起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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金净值走势图

注:基金依法应自成立日起6个月内达到基金合同约定的资产组合,截至2010年4月23日,截至报告期末,本基金未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及基金经理的经验

基金管理人是2003年3月7日正式成立的合资基金管理公司,截至本报告期末,2011年12月31日,所管理的公募基金投资范围包括股票型基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进基金经理、行业精选基金、海外中国基金经理、大盘精选基金、增强收益基金、中证100基金、上证180ETF、上证180ETF联接基金、新兴产业基金、成熟市场交易型开放式基金、转债基金、杠杆基金、上证180价值ETF、上证180成长ETF、上证180成长ETF联接基金、华宝油气基金,所管理的开放式证券投资基金资产净值合计37,012,970,285.05元。

4.1.2 基金经理/基金经理助理/基金经理助理情况

姓名 职务 任职日期 说明

徐林明 本基金基金经理 经理 2010年4月23日 -

本基金基金经理助理 2010年4月23日 -