华宝兴业中证100指数证券投资基金

2009 第四季度报告

2009年12月31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:2010年1月21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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年1月18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2009年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业中证100指数	
基金主代码	240014(前端)	240015(后端)
基金运作方式	契约开放式	
基金合同生效日	2009年9月29日	
报告期末基金份额总额	1,026,102,862.55份	
投资目标	本基金通过指数化投资,力争控制本基金的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0.35%,年跟踪误差不超过4%,实现对中证100指数的有效跟踪,谋求基金资产的长期增值。	
投资策略	本基金采用完全复制法进行指数化投资,按照成份股在中证100指数中的基准权重构建指数化投资组合。当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,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人会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。	
业绩比较基准	中证100指数收益率×95%+银行同业存款收益率×5%。	
风险收益特征	本基金具有较高风险、较高预期收益的特征。	
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	

§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(2009年10月1日-2009年12月31日)	2009年9月29日-2009年09月30日
1.本期已实现收益	16,759,107.93	68,603.58
2.本期利润	73,745,126.80	68,603.58
3.加权平均基金份额本期利润	0.0568	0.0000
4.期末基金资产净值	1,075,972,855.98	2,008,820,231.54
5.期末基金份额净值	1.0486	1.0000

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.本基金基金合同生效于2009年9月29日。

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3个月	4.86%	1.41%	16.13%	1.66%	-11.27%	-0.25%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

华宝兴业中证100指数证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2009年9月29日至2009年12月31日)

注:1.本基金基金合同生效于2009年9月29日,截止报告日本基金基金合同生效未满一年。2.基金依法应自成立日期起6个月内达到基金合同约定的资产组合,截至2009年11月6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		
徐林明	本基金基金经理兼任金融工程部副总经理	2009-9-29	-	7年	复旦大学经济学硕士,FRM,证券从业经历7年,曾在兴业证券、凯龙财经(上海)有限公司、中原证券从事金融工程研究工作。2005年8月加入华宝兴业基金管理有限公司,任金融工程部数量分析师,2008年2月起任金融工程部副总经理,2009年9月至今兼任华宝兴业中证100指数证券投资基金。

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、《华宝兴业基金管理有限公司华宝兴业中证100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。

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、每日交易日结报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本报告期内,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同向交易价差的分析;分析结果没有发现交易价差异常。

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

本报告期内,基金管理人管理的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

本报告期内,本基金没有发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

国内外宏观经济向好趋势的进一步明确,存款活期化趋势的加快,海外市场的良好表现支撑了四季度A股市场的表现;海外部分国家刺激政策的逐步退出动作,国内宏观政策的微调,房地产行业的调控,市场融资速度的加快,使得市场的震荡加剧。四季度,经济是主要矛盾,政策是扰动因素,市场整体呈现震荡上行的特征。

本报告期是本基金的建仓期,基于对市场震荡上行的判断,我们制定了稳步建仓的策略,并且基于本基金的契约,我们采用完全复制法建仓。10月初市场超预期的上涨给本基金建仓带来了不利的条件,但在宏观经济超预期明确的背景下,我们及时加快了建仓的节奏,本基金于10月22日打开日常申购赎回,并于11月初基本完成建仓,股票仓位和跟踪偏离度开始符合基金合同的要求。风险和收益的平衡一定程度上影响了建仓的效果。

展望2010年,宏观经济的高增长、温和的通胀、上市公司业绩的高增长和宽松的流动性环境,将是A股市场面临的不错的投资环境,宽松政策的退出是市场面临的较大变数,但经济是主要矛盾。在2009年市场大幅上涨的背景下,2010年投资者是需要降低投资回报预期的一年,但仍是可以期待的一年。四季度,以中证100指数为代表的大盘蓝筹股的表现相对令人失望,但在融资融券、股指期货的步伐越来越近的2010年,我们认为低估值的大盘蓝筹股行情的上演将是大概率事件。

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,优化成分股替代方法,严格控制基金相对目标指数的跟踪误差,实现对中证100指数的有效跟踪。

非常感谢各位持有人能在基金发行低迷时期给予我们信任与重托,这将不断激励和鞭策我们在投资管理工作中更加勤勉尽责、恪尽职守。我们也非常希望华宝兴业中证100指数基金能与投资者一起分享中国经济的美好未来,轻松投资,快乐生活!

§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	1,020,890,642.63	93.36
	其中:股票	1,020,890,642.63	93.36
2	固定收益投资	25,238,304.00	2.31
	其中:债券	25,238,304.00	2.31
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	38,822,769.29	3.55
6	其他资产	8,596,235.75	0.79
7	合计	1,093,547,951.67	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	-	-
B	采掘业	135,972,730.01	12.64
C	制造业	206,178,275.10	19.16
C0	食品、饮料	39,548,520.72	3.68
C1	纺织、服装、皮毛	4,258,322.25	0.40
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	14,896,411.06	1.38
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	67,828,817.92	6.30
C7	机械、设备、仪表	77,042,567.08	7.16
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	2,603,636.07	0.24
D	电力、煤气及水的生产和供应业	38,367,391.36	3.57
E	建筑业	27,899,154.22	2.59
F	交通运输、仓储业	44,846,753.39	4.17
G	信息技术业	27,016,009.01	2.51
H	批发和零售贸易	14,603,061.88	1.36
I	金融、保险业	461,563,555.44	42.90
J	房地产业	52,707,414.64	4.90
K	社会服务业	7,020,023.18	0.65
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	4,716,274.40	0.44
	合计	1,020,890,642.63	94.88

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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	2,868,102	51,769,241.10	4.81
2	601318	中国平安	937,266	51,633,983.94	4.80
3	600016	民生银行	5,838,382	46,181,601.62	4.29
4	601328	交通银行	4,739,938	44,318,420.30	4.12
5	600030	中信证券	1,214,257	38,576,944.89	3.59
6	601166	兴业银行	922,111	37,170,294.41	3.45
7	600000	浦发银行	1,704,884	36,978,933.96	3.44
8	601088	中国神华	860,878	29,975,771.96	2.79
9	000002	万科A	2,532,736	27,378,876.16	2.54
10	601628	中国人寿	718,184	22,759,250.96	2.12

5.3.2 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

本基金本报告期末未持有积极投资。

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	25,238,304.00	2.35
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	25,238,304.00	2.35

5.5 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

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	010004	20国债(4)	250,380	25,238,304.00	2.35

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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	7,660,423.37
3	应收股利	-
4	应收利息	447,110.42
5	应收申购款	488,701.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	8,596,235.75

5.8.4 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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.1 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。

5.8.5.2 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,008,751,627.96
报告期期间基金总申购份额	158,036,612.24
报告期期间基金总赎回份额	1,140,685,377.65
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	1,026,102,862.55

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:华宝兴业中证100指数证券投资基金基金合同;华宝兴业中证100指数证券投资基金招募说明书;华宝兴业中证100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。

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
二〇一〇年一月二十一日

华宝兴业先进成长股票型证券投资基金

2009 第四季度报告

2009年12月31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:2010年1月21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2010年1月18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2009年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业先进成长股票
基金主代码	240009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月7日
报告期末基金份额总额	1,459,974,161.89份
投资目标	分享我国经济增长方式转变过程中和转变完成后的先进企业的成长,在控制风险的前提下为基金份额持有人谋求长期超额回报。
投资策略	本基金将使用定量与定性相结合的方法,选择具备创新能力强、注重资源节约与环境友好、充分发挥人力资源优势这三个先进因素之一的企业进行投资,重点关注国家产业结构调整中鼓励类行业,同时也兼顾有先进企业的传统行业。
业绩比较基准	新上证综指收益率。
风险收益特征	本基金是一只积极型的股票投资基金,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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2009年10月1日-2009年12月31日)
1.本期已实现收益	215,826,155.87
2.本期利润	679,175,996.75
3.加权平均基金份额本期利润	0.4382
4.期末基金资产净值	3,682,803,291.52
5.期末基金份额净值	2.5225

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3个月	19.87%	1.63%	17.83%	1.61%	2.04%	0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

华宝兴业先进成长股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2006年11月7日至2009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2007年5月7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		
吴丰树	本基金基金经理、华宝兴业行业精选股票基金基金经理	2009-5-14	-	6年	硕士,拥有CFA资格。2003年2月至2008年5月任中国国际金融有限公司研究部副总经理级研究员。2008年5月加入华宝兴业基金管理有限公司,同年9月至2009年12月任行业精选基金基金经理,2009年5月至今任华宝兴业先进成长股票基金基金经理。

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、《华宝兴业先进成长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、每日交易日结报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。 本报告期内,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同向交易价差的分析;分析结果没有发现交易价差异常。

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

本报告期内,基金管理人管理的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

本报告期内,本基金没有发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2009年第四季度,市场走出了一波震荡上行的反弹行情。由于坚定看多市场,我们比较幸运地牢牢抓住这轮行情积极做多。本基金的净值因此取得较好的回报,继续跑赢比较基金比较基准和沪深300指数。在股票仓位上,本基金第四季度基本保持在90%以上的水平,这对基金取得较好的回报贡献最大。在行业选择上,本基金则操作欠佳:过早地减持了消费类股票的配置权重,过早地加大了以银行为代表地大市值股票的配置比例。而在地产板块,本基金没能及时获利了结成为最遗憾的败笔。我们虽然低估了政策打压对地产股的负面影响程度。

展望2010年第一季度,我们认为投资的难度已经大幅度地上升。一方面,投资者对于国内政策正常化的预期很强;另一方面,股票市场的供给量大幅度上升。随着美元的走强,人民币是否能够有保强的升值预期从而导致热钱的大量流入,现在看来也需要观察。当然,我们丝毫不怀疑经济基本面的继续向好,但不能忽视的是一些强势板块也被过度关注,股价似乎已经大幅度跑在了基本面的前头,再要想取得超额收益已经比较困难。不过,幸运的是,我们依然可以找到一些估值洼地,比如银行;国内经济结构的及时调整有利于经济复苏和发展的可持续性。此外,我们观察到美国经济正在如期地复苏,美元崩溃的风险很小。这表明,市场并非没有投资机会,只是我们必须降低投资回报的预期,同时加大力度挖掘个股机会。

§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	3,371,583,130.50	90.91
	其中:股票	3,371,583,130.50	90.91
2	固定收益投资	99,670,000.00	2.69
	其中:债券	99,670,000.00	2.69
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	226,176,000.54	6.10
6	其他资产	11,411,356.97	0.31
7	合计	3,708,840,488.01	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	34,545,000.00	0.94
B	采掘业	85,326,850.00	2.32
C	制造业	1,338,058,704.62	36.33
C0	食品、饮料	11,410,517.32	0.31
C1	纺织、服装、皮毛	67,324,995.66	1.83
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	90,760,000.00	2.46
C4	石油、化学、塑胶、塑料	162,468,100.20	4.41
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	587,556,331.02	15.95
C7	机械、设备、仪表	371,587,580.90	10.09
C8	医药、生物制品	17,782,865.80	0.48
C99	其他制造业	29,168,313.72	0.79
D	电力、煤气及水的生产和供应业	44,205,000.00	1.20
E	建筑业	532,002.24	0.01
F	交通运输、仓储业	225,175,202.44	6.11
G	信息技术业	297,781,973.96	8.09
H	批发和零售贸易	59,907,000.00	1.63
I	金融、保险业	931,793,523.30	25.30
J	房地产业	255,564,241.24	6.94
K	社会服务业	66,518,632.70	1.81
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	32,175,000.00	0.87
	合计	3,371,583,130.50	91.55

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	600050	中国联通	26,000,000	189,540,000.00	5.15
2	601318	中国平安	2,600,000	143,234,000.00	3.89
3	601939	建设银行	19,999,907	123,799,424.33	3.36
4	600030	中信证券	3,799,873	120,721,965.21	3.28
5	600036	招商银行	6,499,995	117,324,909.75	3.19
6	000898	鞍钢股份	6,299,872	100,797,952.00	2.74
7	600585	海螺水泥	2,000,000	99,720,000.00	2.71
8	600761	安徽合力	6,900,000	98,049,000.00	2.66
9	600660	福耀玻璃	6,499,917	97,108,759.98	2.64
10	600016	民生银行	11,000,301	87,012,380.91	2.36

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	-	-
2	央行票据	99,670,000.00	2.71
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	99,670,000.00	2.71

5.5 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

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	0901057	09央行票据57	1,000,000	99,670,000.00	2.71

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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 本基金股票投资的主要对象是先进企业股票,基金管理人建立有基金股票备选库。本报告期内本基金的前十名股票投资没有超出基金合同规定的股票备选库。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,481,593.24
2	应收证券清算款	8,390,651.98
3	应收股利	-
4	应收利息	225,566.12
5	应收申购款	313,545.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,411,356.97

5.8.4 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。

5.8.5 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的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,690,296,376.46
报告期期间基金总申购份额	28,595,639.14
报告期期间基金总赎回份额	258,917,853.71
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	1,459,974,161.89

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:华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金合同;华宝兴业先进成长股票型证券投资基金招募说明书;华宝兴业先进成长股票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。

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
二〇一〇年一月二十一日

华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金

2009 第四季度报告

2009年12月31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:2010年1月21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。 基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年1月18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2009年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业海外中国股票(QDII)
基金主代码	241001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年5月7日
报告期末基金份额总额	124,063,573.06份
投资目标	主要投资于海外上市的中国公司的股票,在全球资本市场分享中国经济增长,追求资本长期增值。
投资策略	本基金将结合宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析,主动判断市场时机,进行积极的资产配置,合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例,以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。本基金各类资产配置的比例范围为:股票占基金资产总值的60%-95%,债券和其他资产占基金资产总值的5%-40%。
业绩比较基准	MSCI china free指数(以人民币计算)。
风险收益特征	本基金为股票型基金,在证券投资基金中属于风险和收益水平都较高的品种。
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
境外投资顾问英文名称	Société Générale Asset Management (Japan) Co., Ltd.
境外投资顾问中文名称	法国兴业银行资产管理(日本)有限公司
境外资产托管人英文名称	The Bank of New York Mellon Corporation
境外资产托管人中文名称	纽约梅隆银行

§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(2009年10月1日-2009年12月31日)
1.本期已实现收益	7,789,861.39
2.本期利润	17,381,867.78
3.加权平均基金份额本期利润	0.1284
4.期末基金资产净值	140,740,445.93
5.期末基金份额净值	1.134

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3个月	11.72%	1.43%	9.36%	1.54%	2.36%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2008年5月7日至2009年12月31日)

注:按照基金合同的约定,自基金合同生效之日起不超过6个月内完成建仓,截至2008年11月6日,本基金已经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		
周欣	本基金基金经理,公司海外投资管理部总经理	2009-12-31	-	10年	北京大学经济学硕士、耶鲁大学商学院工商管理硕士,证券从业经历10年,曾在中国证监会任职,在德意志银行亚洲证券、法国巴黎银行亚洲证券、东方证券资产管理部从事证券研究投资工作。2009年12月加入华宝兴业基金管理有限公司,任海外投资管理部总经理。2009年12月至今兼任华宝兴业海外中国股票(QDII)基金基金经理。
Gabriel GONDARD	本基金基金经理,公司投资副总监	2008-5-7	2009-12-31	8年	法国国籍。毕业于巴黎高等商学院,获资产管理学硕士学位。曾在法国兴业资产管理公司从事投资管理工作,2006年1月加入本公司,担任公司投资副总监。2008年5月至今兼任华宝兴业海外中国股票(QDII)基金基金经理。

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
Marco Wong	亚太区策略主管	22年	1986年加入法兴资产。之前在东京担任分析师和日本股票及可转债组合经理。1989年拓展到亚太区。1996年至2004年担任亚洲(除日本)策略投资总监。2005年至2006年在东京担任太平洋地区总监。2007年至新加坡担任亚太区策略主管。Wong拥有香港大学荣誉社会科学学士学位,并是CFA注册会员。
Winson Fong	大中华区策略主管	22年	1986年加入法兴资产,随后成为日本股票组合基金经理,为海外机构客户提供服务。1990年,覆盖区域拓展到太平洋地区。在法兴日本和法兴香港时,派往新加坡担任大中华区专业人员。2004年至2006年,提任为亚洲(除日本)主管,2007年初,任命为大中华区股票主管,并派往香港工作。Mr Fong拥有香港大学工商管理学士学位,并是CFA注册会员。

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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及其各项实施细则、《华宝兴业海外中国成长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。

由于换汇导致华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金在短期内出现过现金及一年内到期债券比例略低于5%的情况。发生此类情况后,基金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。

4.4 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、每日交易日结报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。 本报告期内,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同向交易价差的分析;分析结果没有发现交易价差异常。

4.4.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业