华宝兴业收益增长混合型证券投资基金

2010 第三季度报告

2010年9月30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10月26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10月22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2010年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业收益增长混合
基金主代码	240008
交易代码	240008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年6月15日
报告期末基金份额总额	1,825,815,105.71份
投资目标	投资稳定分红和有分红潜力的价值被低估上市公司,以分享该类上市公司的长期稳定的股息收入及资本增值。
投资策略	本基金采取积极的资产配置策略,通过公司自行开发的数量化辅助模型,结合宏观策略研究,对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪,决定大类资产配置比例。股票投资部分采用定量与定性分析相结合,行业配置与定期调整策略;债券投资部分通过大资产配置、分类资产配置和个券选择三个层次自上而下进行债券投资管理。
业绩比较基准	65%上证红利指数收益率+35%上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是混合型基金,风险高于债券基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中等风险品种。
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(2010年7月1日-2010年9月30日)
1.本期已实现收益	-276,935,135.04
2.本期利润	941,415,058.75
3.加权平均基金份额本期利润	0.4632
4.期末基金资产净值	5,741,447,527.90
5.期末基金份额净值	3.1446

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	17.10%	1.03%	4.69%	0.81%	12.41%	0.22%

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

华宝兴业收益增长混合型证券投资基金

累计份额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6月15日至2010年9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2006年12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		
邵喆阳	本基金基金经理、华宝兴业大盘精选股票基金经理助理	2010-6-26	-	4年	硕士,拥有CFA资格。2005年7月至2006年12月任安永会计师事务所审计员。2006年12月加入华宝兴业基金管理有限公司任行业分析师,2008年5月起任华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理助理,2008年9月起兼任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理助理,2010年6月任华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理。
冯刚	国内投资部总经理、本基金基金经理兼任大盘精选基金基金经理	2006-6-15	2010-7-28	10年	硕士,曾在联合证券有限公司、华安基金管理公司、长城证券从事投资、研究、投资银行等工作。2004年3月加入华宝兴业基金管理有限公司,任高级分析师、基金经理助理,2006年6月至2010年7月任华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理,2008年10月至2010年7月任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理,2009年5月至2010年7月任国内投资部总经理。

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、《华宝兴业收益增长混合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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金在2010年3季度始终坚持在经济复苏中寻找机会,在政府扩大内需和调整经济结构中寻找投资标的。2010年3季度以来,政府进一步加大宏观调控力度,尤其收紧货币供应,使得以房地产,金融,煤炭,有色,钢铁为代表的大市值板块下跌较多,并进一步带动家电,建材等房地产产业链相关行业的公司股价下跌。

进入2010年3季度后,本基金及时调整组合结构并适度减少仓位,为本基金的组合不断加入顺应经济结构调整方向的成长性个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2010年3季度基金净值增长率17.10%,基金业绩比较基准增长率为4.69%,基金领先基准12.41%。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2010年4季度,我们认为影响股指走势的因素将更为复杂,有利与不利的因素兼而有之。总体而言,我们始终相信中国经济的潜力还巨大,在新经济出现之前,其实经济不平衡是发展的最大瓶颈,如果不平衡的状况得到缓解;外贸依赖下降,东西部更加平衡,社会保障制度更加充分,各种要素价格、资源配置更加合理,那么,从人均福利的角度看,传统经济在内需方面,无论投资和消费结构性升级仍有很大空间。

我们的投资策略将充分考虑上述因素对市场的影响,重点关注业绩明显改善的行业和个股。行业中的领先公司或者具有较高管理水平的公司,有可能在经济震荡中进一步增强竞争力,这类公司是我们重点关注的对象。同时09年3季度至今累积的不同板块之间,不同风格之间的差异有可能在四季度有一些转变,我们要为此做好准备。

具体投资策略而言,估值很低的金融,业绩持续增长的医药,低端劳动力的重大拐点长期利好机械装备,受益于美元贬值的大宗商品,节能减排,化工新材料,铁路设备,3G应用,文化传媒等都是我们将密切关注行业或者投资主题。在此基础上,我们将继续精选具有自主创新能力的制造业龙头、需求增长稳定的消费类公司和估值更低的股票,同时关注被错杀的板块。

§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	4,331,363,203.93	73.32
	其中:股票	4,331,363,203.93	73.32
2	固定收益投资	351,490,000.00	5.95
	其中:债券	351,490,000.00	5.95
	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	1,213,968,030.39	20.55
6	其他资产	10,899,481.49	0.18
7	合计	5,907,720,715.81	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	132,402,285.18	2.31
B	采掘业	280,149,795.19	4.88
C	制造业	2,498,760,319.16	43.52
C0	食品,饮料	615,928,631.64	10.73
C1	纺织,服装,皮毛	-	-
C2	木材,家具	-	-
C3	造纸,印刷	-	-
C4	石油,化学,塑胶,塑料	210,501,623.16	3.67
C5	电子	181,046,574.08	3.15
C6	金属,非金属	569,416,567.75	9.92
C7	机械,设备,仪表	507,918,351.90	8.85
C8	医药,生物制品	365,064,319.83	6.36
C99	其他制造业	48,884,250.80	0.85
D	电力,煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	154,717,287.87	2.69
F	交通运输,仓储业	-	-
G	信息技术业	73,087,516.80	1.27
H	批发和零售贸易	385,198,246.48	6.71
I	金融,保险业	438,003,345.22	7.63
J	房地产业	33,599,689.20	0.59
K	社会服务业	241,989,071.83	4.21
L	传播与文化产业	7,965,000.00	0.14
M	综合类	85,490,647.00	1.49
	合计	4,331,363,203.93	75.44

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	002051	中工国际	3,119,577	186,519,508.83	3.25
2	600547	山东黄金	3,300,947	184,423,908.89	3.21
3	002080	中材科技	3,359,023	174,266,113.24	3.04
4	600690	青岛海尔	6,699,377	157,502,353.27	2.74
5	601166	兴业银行	6,800,000	157,216,000.00	2.74
6	601318	中国平安	2,600,224	137,525,847.36	2.40
7	600036	招商银行	9,849,963	127,557,020.85	2.22
8	600887	伊利股份	2,999,941	125,787,526.13	2.19
9	600519	贵州茅台	640,327	108,042,374.71	1.88
10	000858	五粮液	3,000,394	103,003,526.02	1.79

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	351,490,000.00	6.12
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	351,490,000.00	6.12

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	0801047	08央行票据47	2,500,000	253,450,000.00	4.41
2	1001021	10央行票据21	1,000,000	98,040,000.00	1.71
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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 本基金股票投资的主要对象是稳定分红的股票,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	3,883,538.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,198,038.73
5	应收申购款	817,904.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,899,481.49

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

本报告期期初基金份额总额	2,118,650,966.24
本报告期基金总申购份额	34,514,505.99
减:本报告期基金总赎回份额	327,350,366.52
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	1,825,815,105.71

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:华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金合同;华宝兴业收益增长混合型证券投资基金招募说明书;华宝兴业收益增长混合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

二〇一〇年十月二十六日

华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2010 第三季度报告

2010年9月30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
报告送出日期:二〇一〇年十月二十六日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年10月22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2010年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

基金简称	华宝兴业上证180价值ETF联接
基金主代码	240016
交易代码	240016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年4月23日
报告期末基金份额总额	401,357,154.82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。
业绩比较基准	95%×上证180价值指数收益率+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	中国工商银行股份有限公司

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	上证180价值ETF
基金主代码	510030
基金运作方式	交易型,开放式
基金合同生效日	2010年4月23日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2010年5月28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	中国工商银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品概况

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、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。

§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(2010年7月1日-2010年9月30日)
1.本期已实现收益	4,647,753.87
2.本期利润	14,168,203.29
3.加权平均基金份额本期利润	0.0303
4.期末基金资产净值	377,891,870.45
5.期末基金份额净值	0.942

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	0.86%	1.17%	2.01%	1.25%	-1.15%	-0.08%

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

华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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

(2010年4月23日至2010年9月30日)

注:1、本基金基金合同生效于2010年4月23日,截止报告日本基金基金合同生效未满一年。

2、按照基金合同的约定,自基金成立日期的3个月内达到规定的资产组合,截至2010年7月底,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、华宝兴业中证100指数基金经理、华宝兴业上证180价值ETF基金经理、量化投资部总经理	2010-4-23	-	8年	复旦大学经济学硕士,FRM,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,曾任金融工程部数量分析师、金融工程部副总经理。2009年9月起任华宝兴业中证100指数型证券投资基金基金经理。2010年2月起任量化投资部总经理。2010年4月兼任华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

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、《华宝兴业上证180价值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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度,在宏观调控力度放缓预期和流动性放松的正面影响下,A股市场迎来上涨,上证指数上涨幅度达10.73%。结构分化无疑是三季度市场的主旋律,在经济转型的大背景下,消费、新兴产业受到政策的全力扶持,农林牧渔、食品饮料、交运设备、商业贸易、医药生物等消费行业涨幅超过30%;而房地产调控、淘汰落后产能对传统行业全面打压,金融、公用事业、交通运输、钢铁、房地产、化工等传统行业表现落后。风格分化进一步强化,以中证100指数为代表的大盘股指数上涨9.74%,而以中证500指数为代表的小盘股指数上涨27.18%。

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2010年9月30日,本基金份额净值为0.942元,本报告期份额净值增长率为0.86%,同期业绩比较基准增长率为2.01%。本报告期内本基金的日均跟踪偏离度为0.10%,年化跟踪误差为2.51%。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于中国经济和证券市场的走势我们继续强调"风物长宜放眼量",对于中国经济的前景我们不悲观,目前的经济结构调整的政策布局,可以越来越清晰地看到未来中国经济增长的三大主要引擎:城镇化、消费和人民币国际化。

在房地产调控,打击投机性炒房的环境下,资本市场市场正逐渐成为吸纳流动性的场所,并发挥资产有效配置的功能,助力经济转型,这可能是政府乐见或者引导的局面。而在美国、日本等新的量化宽松政策的背景下,人民币持续升值,大宗商品、股票等风险资产价格正面临新一轮的重估。

近1年以来,风格和行业轮动曾多次被投资者期待,但却每每落空。然而10月份以来,这些变化都发生了:周期品大幅跑赢消费品,大盘股大幅跑赢小盘股。新兴行业的高估值和传统行业的低估值是今年以来投资者一直面临的一个局面,市场的供求关系和增长预期变化是其再平衡的驱动力。四季度将迎来中小盘次新股的解禁高峰,而大股票的融资压力小于前三季度。传统行业在四季度面临价值重估,而重估的高度还需取决于经济增长预期的变化。

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赎顺回,严格控制基金相对目标指数的跟踪误差,实现对上证180价值指数的有效跟踪

§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	1,355,158,566.37	99.75
	其中:股票	1,355,158,566.37	99.75
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	1,501,231.82	0.11
6	其他资产	1,949,248.48	0.14
7	合计	1,358,609,046.67	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	-	-
C0	食品,饮料	-	-
C1	纺织,服装,皮毛	-	-
C2	木材,家具	-	-
C3	造纸,印刷	-	-
C4	石油,化学,塑胶,塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属,非金属	-	-
C7	机械,设备,仪表	-	-
C8	医药,生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力,煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输,仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融,保险业	-	-
J	房地产业	2,065,241.70	0.15
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,065,241.70	0.15

5.2.2 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	209,935,062.07	15.47
C	制造业	135,947,281.98	10.02
C0	食品,饮料	-	-
C1	纺织,服装,皮毛	10,021,664.92	0.74
C2	木材,家具	-	-
C3	造纸,印刷	-	-
C4	石油,化学,塑胶,塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属,非金属	58,679,633.13	4.32
C7	机械,设备,仪表	47,197,143.56	3.48
C8	医药,生物制品	20,048,840.37	1.48
C99	其他制造业	-	-
D	电力,煤气及水的生产和供应业	78,303,538.15	5.77
E	建筑业	38,631,274.63	2.85
F	交通运输,仓储业	43,618,444.05	3.21
G	信息技术业	33,676,295.36	2.48
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融,保险业	793,637,736.29	58.47
J	房地产业	16,532,106.30	1.22
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	2,811,591.84	0.21
	合计	1,353,093,330.67	99.69

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	600036	招商银行	9,745,228	126,200,702.60	9.30
2	601328	交通银行	16,415,800	95,211,640.00	7.01
3	600016	民生银行	17,801,535	90,787,828.50	6.69
4	601166	兴业银行	3,303,093	76,367,510.16	5.63
5	600000	浦发银行	5,424,197	70,297,593.12	5.18

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

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	600606	金丰投资	290,470	2,065,241.70	0.15

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。

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

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	-
3	应收股利	1,918,871.21
4	应收利息	283.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,093.80
8	其他	-
9	合计	1,949,248.48

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。

5.8.5.1 期末指数投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前五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

本基金本报告期末积极投资前五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

本报告期期初基金份额总额	693,528,726
本报告期基金总申购份额	167,000,000
减:本报告期基金总赎回份额	310,000,000
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	550,528,726

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:华宝兴业上证180价值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价值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价值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。

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

二〇一〇年十月二十六日