华宝兴业增强收益债券型证券投资基金

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:中国工商银行股份有限公司
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

基金简称	华宝兴业增强收益债券	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年2月17日	
报告期末基金份额总额	264,802,667.87份	
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下,追求较高的当期收益和总回报,争取实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金采取积极的资产配置策略,通过宏观策略研究,对相关资产类别(包括固定收益类资产、权益类资产和货币资产等)的预期收益进行动态跟踪,决定其配置比例。	
业绩比较基准	中国债券总指数收益率	
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。在债券型基金产品中,其长期平均风险程度和预期收益率高于纯债券基金。	
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	华宝兴业增强收益债券A	华宝兴业增强收益债券B
下属两级基金的交易代码	240012	240013
报告期末下属两级基金的份额总额	121,580,152.17份	143,222,515.70份

§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)	
	华宝兴业增强收益债券A	华宝兴业增强收益债券B
1.本期已实现收益	349,070.35	-346,658.28
2.本期利润	4,445,476.73	3,645,355.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.0316	0.0292
4.期末基金资产净值	129,957,531.06	152,098,129.63
5.期末基金份额净值	1.0689	1.0620

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

1、华宝兴业增强收益债券A:

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	2.95%	0.16%	0.16%	0.05%	2.79%	0.11%

2、华宝兴业增强收益债券B:

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	2.85%	0.16%	0.16%	0.05%	2.69%	0.11%

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

华宝兴业增强收益债券型证券投资基金
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
(2009年2月17日至2010年9月30日)

1.华宝兴业增强收益债券A:

2.华宝兴业增强收益债券B:

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2009年8月16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		
牟旭东	国内投资部总经理、本基金基金经理、多策略基金基金经理、宝康灵活配置基金基金经理	2009-2-17	-	13年	硕士。1997年9月至2003年1月在南方证券有限公司从事证券研究工作,2003年1月加入本公司,任高级分析师,2004年9月起任研究部副总经理,2007年9月起任研究部总经理。2007年10月至今任多策略基金基金经理,2009年2月至今兼任增强收益基金基金经理,2010年1月至今兼任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理,2010年7月起任国内投资部总经理。
华志贵	本基金基金经理、华宝兴业现金宝货币基金经理	2010-6-26	-	6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,任基金经理助理兼高级分析师,2010年6月至今任华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理,2010年6月兼任华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理。

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、《华宝兴业增强收益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

2010年第3季度债券市场小幅度震荡走低。增强收益基金兑现了前期试探性国债头寸的部分利润。信用债一直维持较高比例的配置,获取稳定的票息收入;同时也考虑信用风险。本基金可圈可点的地方在于转债加大了配置,适当享受了大盘的上涨行情。

增强收益基金同时加大了股票仓位。自新股发行启动以来,增强收益基金一直积极参与,获取一、二级市场的差价。第3季度继续执行新股申购策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2010年第3季度,本基金A类涨幅为2.95%,B类涨幅为2.85%,基金基准涨幅为0.16%。

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年第4季度,宏观经济继续向好,但政策可能微调。国庆后,央行对几大行定向提高法定准备金率,对银行过度放贷进行警示的信号。银行贷款过多的后续影响会逐步反映出来,物价会继续走高。美国将采取量化宽松的第二轮,这些都讲对资产价格带来影响。所以,利率的风险是在上升。

总之,力争为基金持有人创造可观的正收益。

§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	30,552,943.87	9.55
	其中:股票	30,552,943.87	9.55
2	固定收益投资	238,057,674.84	74.43
	其中:债券	238,057,674.84	74.43
	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	21,909,552.13	6.85
6	其他资产	29,319,187.92	9.17
7	合计	319,839,358.76	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	451,059.45	0.16
B	采掘业	-	-
C	制造业	20,940,911.29	7.42
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	353,835.80	0.13
C2	木材、家具	4,140,000.00	1.47
C3	造纸、印刷	116,409.60	0.04
C4	石油、化学、塑胶、塑料	3,059,478.15	1.08
C5	电子	3,069,479.50	1.09
C6	金属、非金属	2,744,000.00	0.97
C7	机械、设备、仪表	5,219,280.44	1.85
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	2,238,427.80	0.79
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,222,805.95	1.14
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	3,811,367.18	1.35
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	2,126,800.00	0.75
	合计	30,552,943.87	10.83

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	002043	兔宝宝	500,000	4,140,000.00	1.47
2	000877	天山股份	100,000	2,744,000.00	0.97
3	002436	兴森科技	60,000	2,482,200.00	0.88
4	002003	伟星股份	77,994	2,238,427.80	0.79
5	002375	亚厦股份	30,000	2,206,500.00	0.78
6	002410	广联达	30,000	1,560,000.00	0.55
7	300105	龙源技术	14,393	1,165,833.00	0.41
8	002326	永太科技	19,950	1,124,382.00	0.40
9	300075	数字政通	21,300	1,101,210.00	0.39
10	000716	*ST南方	100,000	1,078,000.00	0.38

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	125,467,959.80	44.48
2	央行票据	20,252,000.00	7.18
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	62,540,389.70	22.17
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	29,797,325.34	10.56
7	其他	-	-
8	合计	238,057,674.84	84.40

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	010107	21国债(7)	618,410	66,343,024.80	23.52
2	010110	21国债(10)	354,290	35,960,435.00	12.75
3	0801038	08央行票据38	200,000	20,252,000.00	7.18
4	010112	21国债(12)	180,000	18,288,000.00	6.48
5	113001	中行转债	155,000	16,315,300.00	5.78

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 本基金采取定量与定性相结合的个股精选策略,使用成长、价值、盈利等方面的指标对股票进行排序,并对排名靠前的股票进行案头研究和实地调研,深入研究企业的基本面和长期发展前景,挑选出预期表现将超过大盘的个股,构建核心组合,没有特定的股票备选库。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	25,996,252.86
3	应收股利	-
4	应收利息	2,582,778.74
5	应收申购款	490,156.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,319,187.92

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未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华宝兴业增强收益债券A	华宝兴业增强收益债券B
本报告期期初基金份额总额	167,513,113.65	168,811,781.37
本报告期基金总申购份额	5,027,096.18	51,953,174.74
减:本报告期基金总赎回份额	50,960,057.66	77,542,440.41
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	121,580,152.17	143,222,515.70

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;华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金合同;华宝兴业增强收益债券型证券投资基金招募说明书;华宝兴业增强收益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。

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

华宝兴业中证100指数证券投资基金

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	华宝兴业中证100指数	
基金主代码	240014	
交易代码	240014	240015
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年9月29日	
报告期末基金份额总额	1,119,146,354.60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(2010年7月1日-2010年9月30日)
1.本期已实现收益	-16,366,930.99
2.本期利润	78,175,986.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0700
4.期末基金资产净值	907,104,255.16
5.期末基金份额净值	0.8105

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	9.59%	1.26%	9.27%	1.20%	0.32%	0.06%

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
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2009年9月29日至2010年9月30日)

注: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、华宝兴业上证180价值ETF联接基金经理、量化投资部总经理	2009-9-29	-	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。

由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化,中证100证券投资基金在短期内出现过持有的现金与到期日在一年之内的政府债券市值占基金资产净值比低于5%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

截至本报告期末,本基金份额净值为0.8105元,本报告期份额净值增长率为9.59%,同期业绩比较基准增长率为9.27%。本报告期内本基金的日均跟踪偏离度为0.05%,跟踪误差为0.07%,年化跟踪误差为1.12%,在合同规定的目标控制范围之内。

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购赎回,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。

§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	860,252,480.31	94.60
	其中:股票	860,252,480.31	94.60
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	45,913,745.55	5.05
6	其他资产	3,191,765.45	0.35
7	合计	909,357,991.31	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

本基金本报告期末未持有积极投资。

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	117,354,411.33	12.94
C	制造业	196,366,504.69	21.65
C0	食品、饮料	44,141,069.44	4.87
C1	纺织、服装、皮毛	3,451,561.25	0.38
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	13,569,431.52	1.50
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	46,880,723.23	5.17
C7	机械、设备、仪表	88,323,719.25	9.74
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	28,051,499.01	3.09
E	建筑业	28,981,793.04	3.19
F	交通运输、仓储业	33,739,976.80	3.72
G	信息技术业	22,330,497.50	2.46
H	批发和零售贸易	18,032,765.05	1.99
I	金融、保险业	368,666,337.70	40.64
J	房地产业	37,019,925.54	4.08
K	社会服务业	5,398,516.35	0.60
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	4,310,253.30	0.48
	合计	860,252,480.31	94.84

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	3,842,909	49,765,671.55	5.49
2	601318	中国平安	906,610	47,950,602.90	5.29
3	600016	民生银行	7,257,096	37,011,189.60	4.08
4	601328	交通银行	5,610,170	32,538,986.00	3.59
5	601166	兴业银行	1,146,664	26,510,871.68	2.92
6	600000	浦发银行	1,878,239	24,341,977.44	2.68
7	000002	万科A	2,642,636	22,198,142.40	2.45
8	601088	中国神华	886,909	20,939,921.49	2.31
9	600030	中信证券	1,909,558	20,317,697.12	2.24
10	601601	中国太保	860,358	18,755,804.40	2.07

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

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

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。

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	116,364.89
2	应收证券清算款	2,296,009.07
3	应收股利	652,644.01
4	应收利息	9,228.22
5	应收申购款	117,519.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,191,765.45

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

本报告期期初基金份额总额	1,084,673,132.09
本报告期基金总申购份额	149,552,166.24
减:本报告期基金总赎回份额	115,078,943.73
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	1,119,146,354.60

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
二〇一〇年十月二十六日

东方金账簿货币市场证券投资基金

2010 第三季度报告

2010年9月30日

基金管理人:东方基金管理有限责任公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
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。

基金托管人中国民生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	东方金账簿货币
基金主代码	400005
交易代码	400005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年8月2日
报告期末基金份额总额	223,071,807.06份
投资目标	在强调本金安全性、资产充分流动性的前提下,追求稳定的当期收益。
投资策略	本基金以价值分析为基础,以主动式的科学投资管理为手段,把握宏观经济走向与微观经济脉搏,通过以剩余期限为核心的资产配置,充分考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征,追求基金资产稳定的当期收益。
业绩比较基准	银行税后活期利率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率均低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

§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	1,096,797.68
2.本期利润	1,096,797.68
3.期末基金资产净值	223,071,807.06

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本基金收益分配按月结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.4625%	0.0029%	0.0907%	0.0000%	0.3718%	0.0029%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方金账簿货币市场证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2006年8月2日至2010年9月30日)

注:本基金建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

注:①本基金管理人于2010年9月16日发布了《东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理变更公告》,聘任王丹丹女士为本基金基金经理,于鑫先生不再担任本基金基金经理。

②此处的任职日期和离任日期均指在法定信息披露媒体正式公告之日。

③证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《东方金账簿货币市场证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内本基金运作符合公平交易制度,未发现存在可能导致不公平交易和利益输送交易行为。

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

本报告期内本公司无与本基金投资风格相类似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内本基金运作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

2010年3季度,宏观经济政策处于观察期,工业增加值、固定资产投资环比企稳反弹,出口增速高位有所回落,但CPI处于上行趋势,9月份创下年内新高。另一方面,房地产销量见底回升,新开工面积居高不下,国家于9月底出台了对房地产市场的再调控,总体的政策基调未发生明显改变。海外发达经济体复苏进程放缓,日本于9月和10月分别出台了量化宽松的刺激政策,对美国于11月出台量化宽松政策的预期也日渐浓厚。总体看,短端利率呈现先抑后扬态势,中长端收益率平均上行5-10bp。

货币市场利率在3季度呈现先抑后扬的态势,8月底的工行可转债发行、9月份的季末及长假因素成为推动货币市场利率上扬的主要因素,在9月份这一轮货币市场利率上行中,回购利率和短融利率幅度较大,但短期央票利率由于成交较少,变化不大。本基金在3季度的投资可归纳为以下几个方面:1. 注重对回购资产和其他利率资产的轮换投资;2. 重点加强对短融的投资力度和组合调整;3. 仔细甄别货币市场中个券的定价,对定价失误的券种进行积极的操作;4. 清空组合中的固定利率央票、金融债,以持有浮息债为主。总体来看,组合的静态收益进一步提高,偏离度保持稳定,剩余期限维持适中。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2010年9月30日,本基金净值收益率为0.4625%,业绩比较基准收益率为0.0907%,高于业绩比较基准0.3718%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望第4季度,市场对经济的悲观预期逐渐消退,海外量化宽松的政策带来通胀预期,提升权益类资产的价格,债券类资产处于压制状态,风险逐渐暴露,本基金继续维持对浮息债的投资力度,适当参与定期存款投资,增加对短融的投资力度,控制久期,确保组合具有充足的流动性。"诚信是基,回报为金",我们珍惜持有人的每一份利益,用我们的专业知识、勤恳态度,谋求长期、稳定的回报。

§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	固定收益投资	180,166,477.87	77.74
	其中:债券	180,166,477.87	77.74
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	50,000,395.00	21.57
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	626,643.37	0.27
4	其他各项资产	976,032.29	0.42
5	合计	231,769,548.53	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额		6.76
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	7,999,876.00	3.59
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	124
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	163
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	59

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过180天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	45.13	3.59
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	17.97	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	4.49	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	35.88	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	103.47	3.59

注:本报告期末本基金未持有剩余期限小于397天,但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。

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	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	90,126,855.61	40.40
	其中:政策性金融债	90,126,855.61	40.40
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	90,039,622.26	40.36
6	其他	-	-
7	合计	180,166,477.87	80.77
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	060202	06国开02	500,000	50,046,735.44	22.44
2	080303	08进出03	400,000	40,080,120.17	17.97
3	1081218	10津创业CP01	100,000	10,022,212.81	4.49
4	1081101	10焦作铝CPO1	100,000	10,014,772.60	4.49
5	0981260	09汉江CP02	100,000	10,007,230.54	4.49
6	1081313	10岳纸CP02	100,000	10,000,355.49	4.48
7	1081315	10大重起CP01	100,000	10,000,355.49	4.48
8	1081276	10北建工CP02	100,000	10,000,259.15	4.48
9	1081207	10兰花CP01	100,000	10,000,000.00	4.48
10	1081324	10凤凰CP01	100,000	9,998,944.40	4.48

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.2427%
报告期内偏离度的最低值	-0.0158%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1483%

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

5.8.2 本报告期内本基金未持有剩余期限小于397天、但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。

5.8.3 本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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.8.4 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	976,032.29
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	976,032.29

§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	225,712,733.14
本报告期基金总申购份额	771,786,235.16
减:本报告期基金总赎回份额	774,427,161.24
本报告期期末基金份额总额	223,071,807.06

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

一、《东方金账簿货币市场证券投资基金基金合同》
二、《东方金账簿货币市场证券投资基金托管协议》
三、东方基金管理有限责任公司批准成立批件、营业执照、公司章程
四、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告

7.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

7.3 查阅方式

投资者可免费查阅,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件,投资者还可在本基金管理人网站(www.orient-fund.com)查阅。

东方基金管理有限责任公司
二〇一〇年十月二十六日