华宝兴业行业精选股票型证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6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:2011年7月20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	华宝兴业行业精选股票
基金主代码	240010
交易代码	240010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年6月14日
报告期末基金份额总额	13,456,173,523.86份
投资目标	把握行业发展趋势和市场运行趋势,精选增长前景良好或周期复苏的行业和企业,在控制风险的前提下,追求基金净值的稳定增长和基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将通过分析宏观经济、产业政策和行业景气程度,精选发展前景良好或景气程度向好的行业,通过行业估值模型与波特五力分析,加强对有吸引力行业的配置。在行业配置比例确定后,本基金将对基金管理人股票库相关精选行业的股票运用定量指标筛选排名靠前的股票,并进行定性分析,确定最终投资组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的较高风险、较高收益的品种。
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

§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(2011年4月1日-2011年6月30日)
1.本期已实现收益	-174,162,232.48
2.本期利润	-548,281,627.11
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0403
4.期末基金资产净值	12,434,465,594.20
5.期末基金份额净值	0.9241

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。

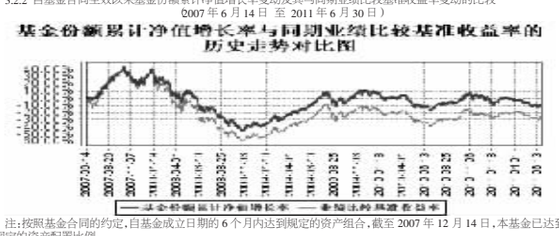
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	-4.18%	0.90%	-5.56%	1.10%	1.38%	-0.20%

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

(2007年6月14日 至 2011年6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2007年12月14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		
任志强	公司副总经理、投资总监、行业精选基金基金经理	2007年9月7日	-	14年	硕士。1995年3月至1997年3月就职于上海市外高桥保税区开发(控股)公司期货部;1997年4月至1999年2月任职于中国南方证券有限公司,从事证券研究工作,1999年3月至2006年10月在华宝信托投资有限责任公司工作,曾担任研究员、研发中心总经理助理、研发中心总经理、投资管理部总经理、公司总裁助理、公司董事会秘书等职务。2006年10月至2007年8月任华宝证券经纪有限公司董事、副总经理。2007年8月加入华宝兴业基金管理有限公司,任投资总监,2007年9月至今兼任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理,2009年6月任命为公司副总经理。
蒋宁	行业精选基金基金经理	2010年7月3日	-	16年	硕士。1995年至1996年任职于上海万国证券公司证券投资总部从事证券研究工作,1996年至2010年3月任职于中银万国证券公司证券投资及金融衍生品总部从事证券投资、研究工作。2010年4月加入华宝兴业基金管理有限公司任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理助理,2010年7月至今任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理。
李靖	先进成长基金基金经理、华宝兴业行业精选股票基金经理	2010年9月4日	-	11年	博士。1999年至2000年任和君创业投资有限公司研究员,2000年至2010年在光大证券有限公司先后任行业研究员、策略研究员、投资经理和定向理财部副总经理的职务。2010年7月加入华宝兴业基金管理有限公司任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理助理,2010年9月至今任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理,2011年2月起兼任华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金经理。

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、《华宝兴业行业精选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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年二季度,国内经济数据疲软,去库存迹象明显,外围经济需求下滑,通胀持续上行。相应的,国内货币政策继续从紧,资金成本、风险溢价都出现明显抬升,导致整体市场估值重心下移,震荡筑底。以食品饮料为首的稳定增长板块,以及以火电为代表的长期固定资产投资力度较低的板块,在二季度的前期体现出了明显的防御性,而以水泥、保障房相关个股为首的周期性板块,进入六月以后呈现明显超额收益。大范围的创业板中小板个股出现戴维斯双杀,跌幅巨大。

本基金的仓位整体先减后增,在4月份降低仓位,在6月中旬市场相对低点增仓至较高水平。从行业板块看,前期主要减持的板块包括黑色金属、交运、机械等周期性板块,后期在建筑建材、采掘、金融、房地产上布局力度较大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金份额净值增长率为-4.18%,比较基准增长率为-5.56%,基金领先基准1.38%。

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2011年第3季度,我们认为,来自通胀的压力以及由此带来的政策紧缩压力将会有所缓解;在保障房等政策的支持下,房地产投资总体出现大幅下滑的概率不大;随着库存调整周期的结束,经济总体将呈现稳中有升的健康态势。而信贷投放节奏今年整体上紧下松,下半年流动性紧张的格局会出现一定程度的改善。

因此,我们对于后市持较为乐观态度,将采取相对积极的投资策略,介入未来盈利下滑忧虑渐消的周期性板块,以及前期跌幅较大的,估值合理的成长性个股。

§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	11,128,607,509.81	89.04
	其中:股票	11,128,607,509.81	89.04
2	固定收益投资	27,380,939.61	0.22
	其中:债券	27,380,939.61	0.22
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	445,050,907.58	3.56
	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	858,066,454.30	6.87
6	其他资产	39,246,859.14	0.31
7	合计	12,498,352,670.44	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	-	-
B	采掘业	1,077,673,304.79	8.67
C	制造业	4,192,210,004.03	33.71
C0	食品、饮料	887,856,579.25	7.14
C1	纺织、服装、皮毛	13,848,855.68	0.11
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	117,272,000.00	0.94
C4	石油、化学、塑胶、塑料	319,213,351.06	2.57
C5	电子	349,266,444.88	2.81
C6	金属、非金属	1,046,506,668.36	8.42
C7	机械、设备、仪表	1,165,872,943.50	9.38
C8	医药、生物制品	292,373,161.30	2.35
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,337,867,727.75	10.76
F	交通运输、仓储业	125,373,031.68	1.01
G	信息技术业	740,995,992.69	5.96
H	批发和零售贸易	136,850,756.04	1.10
I	金融、保险业	2,250,897,528.75	18.10
J	房地产业	491,421,513.91	3.95
K	社会服务业	482,548,474.11	3.88
L	传播与文化产业	98,083,066.24	0.79
M	综合类	194,686,109.82	1.57
	合计	11,128,607,509.81	89.50

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	600036	招商银行	41,013,055	533,989,976.10	4.29
2	002081	金螳螂	12,343,158	496,194,951.60	3.99
3	002304	洋河股份	3,700,000	466,792,000.00	3.75
4	601088	中国神华	14,828,340	446,926,167.60	3.59
5	601318	中国平安	8,960,000	432,499,200.00	3.48
6	600000	浦发银行	36,478,766	358,951,057.44	2.89
7	600585	海螺水泥	12,707,377	352,756,785.52	2.84
8	600582	天地科技	15,785,710	349,495,619.40	2.81
9	002375	亚厦股份	10,026,060	295,768,770.00	2.38
10	601288	农业银行	104,999,871	293,999,638.80	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	-	-
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	中期票据	-	-
7	可转债	27,380,939.61	0.22
8	其他	-	-
9	合计	27,380,939.61	0.22

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	110015	石化转债	147,890	15,949,936.50	0.13
2	110016	川投转债	86,920	9,970,593.20	0.08
3	125887	中期转债	12,402	1,460,409.91	0.01
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增长前景良好或周期复苏的行业和企业,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	15,078,256.39
2	应收证券清算款	10,435,176.09
3	应收股利	12,418,123.06
4	应收利息	980,679.45
5	应收申购款	334,624.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,246,859.14

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金在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情况的说明。

§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	14,065,505,197.84
本报告期基金总申购份额	24,736,764.29
减:本报告期基金总赎回份额	634,068,438.27
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	13,456,173,523.86

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;
华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金合同;
华宝兴业行业精选股票型证券投资基金招募说明书;
华宝兴业行业精选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
2011年7月20日

华宝兴业增强收益债券型证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6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:2011年7月20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	华宝兴业增强收益债券	
基金主代码	240012	
交易代码	240012	
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	105,488,470.64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
下属两级交易代码	240012	240013
下属两级基金报告期末份额总额	52,326,648.85份	53,161,821.79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(2011年4月1日-2011年6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	215,355.26	151,624.59
2.本期利润	314,535.06	246,152.18
3.加权平均基金份额本期利润	0.0056	0.0043
4.期末基金资产净值	54,131,873.07	54,470,949.21
5.期末基金份额净值	1.0345	1.0246

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

华宝兴业增强收益债券A

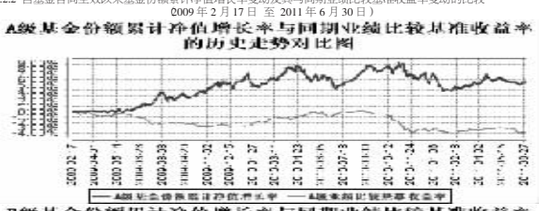
阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准收益率标准差(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
过去三个月	0.42%	0.17%	-0.52%	0.07%	0.94%	0.10%

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)
过去三个月	0.31%	0.17%	-0.52%	0.07%	0.83%	0.10%

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

(2009年2月17日 至 2011年6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		
华志贵	现金宝基金基金经理、增强收益债券基金基金经理、可转债基金基金经理	2010年6月26日	-	7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高级分析师,2010年1月起任华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理助理,2010年5月起兼任华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理助理,2010年6月至今任华宝兴业现金宝货币市场基金、华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理、2011年4月兼任华宝兴业可转债债券型证券投资基金基金经理。

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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年第2季度,央行连续提高存款准备金率,资金面逐步收紧;猪肉价格持续上涨,通胀预期探之不去,国债收益率小幅度上升。因为供给预期增加,信用债收益率也逐步上升。转债市场因为大盘调整而调整。增强收益基金维持国债、信用债的标准配置,享受票息收入;本基金在4月份大幅度减仓,锁定了一季度的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011年2季度,增强收益A净值增长率为0.42%,比较基准收益率-0.52%;增强收益B净值增长率为0.31%,比较基准收益率-0.52%。

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2011年3季度,我们认为通货膨胀仍将维持高位。保障房建设将拖动地方政府发债;公司债发行也将增加,信用债收益率会逐步上升。新股赚钱效应将持续。可转债的供给也会有所增加,一些符合市场热点的品种将会有所表现。

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	1,011,100.00	0.92
	其中:股票	1,011,100.00	0.92
2	固定收益投资	92,776,550.68	84.35
	其中:债券	92,776,550.68	84.35
	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	7,864,208.95	7.15
6	其他资产	8,332,217.37	7.58
7	合计	109,984,077.00	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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	1,011,100.00	0.93
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	540,250.00	0.50
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	470,850.00	0.43
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	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,011,100.00	0.93

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	601208	东材科技	25,000	540,250.00	0.50
2	600216	浙江医药	15,000	470,850.00	0.43

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	55,154,560.00	50.79
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	26,572,778.90	24.47
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	11,049,211.78	10.17
8	其他	-	-
9	合计	92,776,550.68	85.43

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)	261,770	26,962,310.00	24.83
2	010110	21国债(10)	150,000	14,973,000.00	13.79
3	122023	09万业债	91,340	9,518,541.40	8.76
4	010112	21国债(12)	85,000	8,478,750.00	7.81
5	112015	09泛海债	70,000	7,210,000.00	6.64

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	5,885,210.84
3	应收股利	-
4	应收利息	2,191,887.26
5	应收申购款	5,119.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,332,217.37

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110009	双良转债	4,300,242.70	3.96
2	113001	中行转债	4,223,200.00	3.89
3	126729	燕京转债	878,448.48	0.81
4	110078	澄星转债	816,820.20	0.75

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601208	东材科技	540,250.00	0.50	股东大会停牌
2	600216	浙江医药	470,850.00	0.43	临时停牌

§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	61,824,623.84	63,240,029.76
本报告期基金总申购份额	1,096,964.35	882,593.44
减:本报告期基金总赎回份额	10,594,939.34	10,960,801.41
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	52,326,648.85	53,161,821.79

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
2011年7月20日

华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6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:2011年7月20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	华宝兴业新兴产业股票
基金主代码	240017
交易代码	240017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月7日
报告期末基金份额总额	2,684,019,743.90份
投资目标	分享新兴产业所带来的投资机会,力争在长期内为基金份额持有人获取超额回报。
投资策略	本基金采取积极的大类资产配置策略,通过宏观策略研究,对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪,通过对新兴产业相关行业的辨识、精选以及对新兴产业相关股票的深入分析,挖掘该类型企业的投资价值,分享新兴产业发展所带来的较高回报。本基金通过采取自上而下的方法确定投资组合久期,结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。
业绩比较基准	75%中证新兴产业指数+25%上证国债指数。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的较高风险、较高收益的品种。
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

§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(2011年4月1日-2011年6月30日)
1.本期已实现收益	-144,873,321.63
2.本期利润	-206,016,128.73
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0745
4.期末基金资产净值	2,346,047,572.67
5.期末基金份额净值	0.8741

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
过去三个月	-7.69%	1.12%	-6.91%	1.02%	-0.78%	0.10%

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

(2010年12月7日 至 2011年6月30日)

注:1.本基金基金合同生效于2010年12月7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6个月内达到规定的资产组合,截至2011年6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		
郭鹏飞	灵活配置基金经理、新兴产业基金基金经理	2010年12月7日	-	7年	博士,拥有CFA资格。2004年2月加入华宝兴业基金管理有限公司任研究部行业分析师,2007年9月任公司研究部副总经理,2009年3月至2010年6月任公司研究部总经理,2010年6月至今任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理,2010年12月兼任华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金经理。

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、《华宝兴业新兴产业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