

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

2011 第三季度 报告

2011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:2011年10月24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。
基金管理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10月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

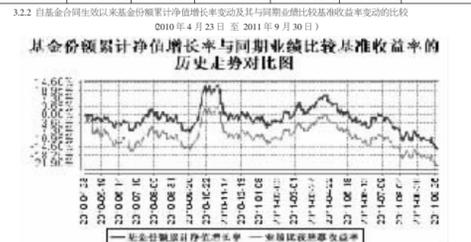
§2 基金产品概况

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金代码, etc.) and Value (华宝兴业上证180价值ETF联接, 240016, etc.)

2.1 基金产品概况
基金名称: 华宝兴业上证180价值ETF联接
基金代码: 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

2.2 目标基金基本情况
基金名称: 上证180价值ETF
基金代码: 510000
交易方式: 交易型开放式
基金合同生效日: 2010年4月23日

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7月1日至2011年9月30日)
1.本期已实现收益 -1,991,987.64
2.本期利润 -90,448,800.69



注:按照基金合同的约定,自基金成立日起的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 基金管理人及基金经理简介
姓名: 徐林明
职务: 基金经理
任本基金基金经理年限: 2010年4月23日至今
证券从业年限: 9年

4.2 管理人报告期内本基金遵守法律法规的情况
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》及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

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10月24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。
基金管理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10月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§2 基金产品概况

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金代码, etc.) and Value (华宝兴业宝康债券, 240003, etc.)

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7月1日至2011年9月30日)
1.本期已实现收益 -6,287,733.82
2.本期利润 -26,267,512.50



注:按照基金合同的约定,自基金成立日起的6个月内达到规定的资产组合,截至2011年1月15日,本系列基金下设的各投资组合均已达到合同规定的资产配置比例。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理简介
姓名: 李俊梁
职务: 宝康债券基金经理
任本基金基金经理年限: 2011年6月28日至今
证券从业年限: 8年

4.2 管理人报告期内本基金遵守法律法规的情况
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、《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》及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

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10月24日

华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011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:2011年10月24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。
基金管理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10月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金代码, etc.) and Value (华宝兴业上证180价值ETF, 510000, etc.)

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7月1日至2011年9月30日)
1.本期已实现收益 -32,502,260.98
2.本期利润 -213,526,661.31



注:本基金自成立之日起6个月内达到规定的资产组合,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 主要财务指标和基金净值表现

Table with 5 columns: Period (阶段), Net Value Growth Rate (净值增长率), etc.

§4 管理人报告

4.1 基金概况(基金经理小组简介)
姓名: 徐林明
职务: 基金经理
任本基金的基金经理期限: 2010年4月23日至今
证券从业年限: 9年

4.2 管理人报告期内本基金遵守法律法规的情况
本报告管理人遵守《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、《上证180价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及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

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10月24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。
基金管理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10月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

2011 第三季度 报告

2011年9月30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。
基金管理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10月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§2 基金产品概况

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金代码, etc.) and Value (宝康债券, 240003, etc.)

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7月1日至2011年9月30日)
1.本期已实现收益 -6,287,733.82
2.本期利润 -26,267,512.50



注:按照基金合同的约定,自基金成立日起的6个月内达到规定的资产组合,截至2011年1月15日,本系列基金下设的各投资组合均已达到合同规定的资产配置比例。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理简介
姓名: 李俊梁
职务: 宝康债券基金经理
任本基金基金经理年限: 2011年6月28日至今
证券从业年限: 8年

4.2 管理人报告期内本基金遵守法律法规的情况
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、《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》及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

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10月24日

§5 投资组合报告

Table with 4 columns: Item (序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%))

§2 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(%)

Table with 4 columns: Item (序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%))

§3 投资组合报告

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: Item (代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%))

§4 投资组合报告

5.2.2 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

Table with 5 columns: Item (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(%))

§5 投资组合报告

5.2.3 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债券投资明细

Table with 5 columns: Item (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(%))

§6 开放式基金业绩变动

本报告期内基金资产组合情况
本报告期内基金资产组合情况

Table with 4 columns: Item (序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%))

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录
中国证监会基金备案的文件:
华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同;
华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金托管协议;
华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金招募说明书;
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司代码;
基金托管人业务资格批件和营业执照。

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10月24日

华宝兴业宝康债券投资基金

2011 第三季度 报告

2011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:2011年10月24日

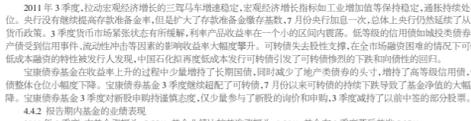
§1 重要提示

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。
基金管理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10月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§2 基金产品概况

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金代码, etc.) and Value (宝康债券, 240003, etc.)

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7月1日至2011年9月30日)
1.本期已实现收益 -6,287,733.82
2.本期利润 -26,267,512.50



注:按照基金合同的约定,自基金成立日起的6个月内达到规定的资产组合,截至2011年1月15日,本系列基金下设的各投资组合均已达到合同规定的资产配置比例。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理简介
姓名: 李俊梁
职务: 宝康债券基金经理
任本基金基金经理年限: 2011年6月28日至今
证券从业年限: 8年

4.2 管理人报告期内本基金遵守法律法规的情况
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、《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》及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

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10月24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。
基金管理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10月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§2 基金产品概况

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金代码, etc.) and Value (宝康债券, 240003, etc.)

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7月1日至2011年9月30日)
1.本期已实现收益 -6,287,733.82
2.本期利润 -26,267,512.50



注:按照基金合同的约定,自基金成立日起的6个月内达到规定的资产组合,截至2011年1月15日,本系列基金下设的各投资组合均已达到合同规定的资产配置比例。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理简介
姓名: 李俊梁
职务: 宝康债券基金经理
任本基金基金经理年限: 2011年6月28日至今
证券从业年限: 8年

4.2 管理人报告期内本基金遵守法律法规的情况
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、《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》及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

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10月24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。
基金管理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10月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§2 基金产品概况

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金代码, etc.) and Value (宝康债券, 240003, etc.)

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7月1日至2011年9月30日)
1.本期已实现收益 -6,287,733.82
2.本期利润 -26,267,512.50



注:按照基金合同的约定,自基金成立日起的6个月内达到规定的资产组合,截至2011年1月15日,本系列基金下设的各投资组合均已达到合同规定的资产配置比例。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理简介
姓名: 李俊梁
职务: 宝康债券基金经理
任本基金基金经理年限: 2011年6月28日至今
证券从业年限: 8年

4.2 管理人报告期内本基金遵守法律法规的情况
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、《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》及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

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10月24日