上证180成长交易型开放式指数证券投资基金

2011 年度 报告摘要

2011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
送出日期:2012年3月29日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2012年3月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计。

本报告期自2011年8月4日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上证180成长交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华宝兴业上证180成长ETF
基金主代码	510280
交易代码	510280
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年8月4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
报告期末基金份额总额	616,754,441.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011-10-18

2.2 基金产品说明

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票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量,并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成长指数
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝兴业基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	唐州徽
	联系电话	021-38505888	010-66594855
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-700-5588、021-38924558	95566
传真		021-38505777	010-66594942

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金年度报告备置地点	本基金年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标			2011年8月4日(基金合同生效日)-2011年12月31日
本期已实现收益			-27,659,102.21
本期利润			-77,403,893.06
加权平均基金份额本期利润			-0.1060
本期加权平均净值利润率			-11.03%
本期基金份额净值增长率			-11.80%
3.1.2 期末数据和指标			2011年末
期末可供分配利润			-73,035,048.43
期末可供分配基金份额利润			-0.1184
期末基金资产净值			543,719,392.57
期末基金份额净值			0.882
3.1.3 累计期末指标			2011年末
基金份额累计净值增长率			-11.80%

注:1、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。

2、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。

3、本基金成立于2011年8月4日,本报告期不是完整报告期且没有过往可比期间。

4、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

5、净值相关数据计算中涉及天数的,包括所有交易日以及季末最后一自然日(如非交易日)。

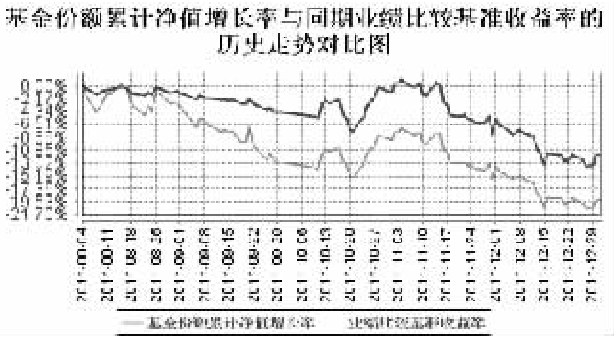
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-7.64%	1.32%	-7.24%	1.38%	-0.40%	-0.06%
自基金合同生效日起至今	-11.80%	1.06%	-19.09%	1.41%	7.29%	-0.35%

注:净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的,包括所有交易日以及季末最后一自然日(如非交易日)。

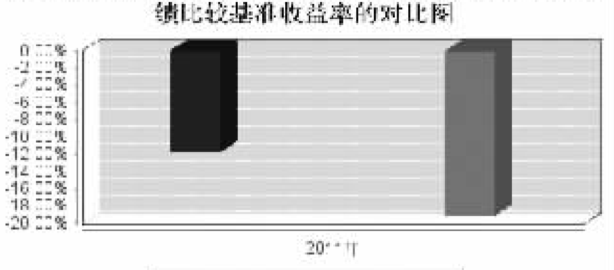
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金基金合同生效于2011年8月4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,截至本报告期末,本基金尚处于建仓期。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是2003年3月7日正式成立的合资基金管理公司,截至本报告期末(2011年12月31日),所管理的开放式证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、增强收益基金、中证100基金、上证180ETF、上证180ETF联接基金、新兴产业基金、成熟市场动量优选基金、可转债基金、上证180成长ETF、上证180成长ETF联接基金、华宝油气基金,所管理的开放式证券投资基金资产净值合计37,012,970,285.05元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
余海燕	本基金基金经理、华宝兴业中证100指数、华宝兴业上证180成长ETF联接基金经理	2011年8月4日	-	5年	硕士。曾在汇丰银行从事信用分析工作。2006年12月加入华宝兴业基金管理有限公司先后任分析师,华宝兴业宝康债券投资基金基金经理助理,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助理,2010年12月至今任华宝兴业中证100指数型证券投资基金基金经理,2011年8月至今兼任华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。
陈建华	本基金基金经理助理、华宝兴业上证180价值ETF、华宝兴业上证180价值ETF联接、华宝兴业上证180成长ETF联接基金经理助理	2011年8月10日	-	10年	经济学硕士。曾在南方证券上海分公司工作。2007年8月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后任助理分析师、数量分析师,2011年6月起任华宝兴业上证180价值ETF、华宝兴业上证180价值ETF联接基金经理助理,2011年8月至今兼任华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。

注:1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 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成长交易型开放式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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对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

纵观2011年,国内外宏观经济形势异常复杂:上半年国内经济增长放缓,通胀高企,CPI逐步上升并创出近三年以来的新高,下半年经济加速下滑,CPI见顶回落,对经济硬着陆的担忧持续升温;海外地区冲突不断,日本地震,欧债危机的冲击,美国复苏进程遇到挑战,世界经济前景不明朗。在持续的高通胀因素下,宏观货币政策在上半年持续紧缩,而后在整体经济增速和CPI的下行背景下,紧缩的宏观政策在出现了微调。在2011年全年中国宏观经济从“滞胀”走向“衰退”,在紧缩的宏观政策和“金融脱媒”因素影响下,2011年A股市场逃脱不了投资时钟指向的宿命,全年A股市场大幅下挫,遭到了源自估值与盈利的双杀。以上证180成长指数、沪深300指数为代表的大盘蓝筹指数全年累计跌幅为21.65%、25.01%,以创业板指P、中小板指P指数为代表的小盘股指数全年累计下跌35.88%、37.09%。

本报告期涵盖了本基金的建仓期,上证180成长ETF基金成立于2011年8月4日,属于完全跟踪指数的投资基金,基于建仓期初国内经济增速放缓,通胀数据下行缓慢,以及欧洲市场债务危机的冲击、美国经济数据疲软的背景下,本基金采取了较为保守的建仓策略。基于ETF产品特点、上市时间和上证180成长指数的投资价值等因素,本基金于10月中旬基本完成建仓,并于10月18日在上交所挂牌交易。本基金自成立以来,我们在操作中严格遵守基金合同,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

截止至本报告期末,本基金份额净值增长率为-11.80,同期业绩比较基准增长率为-19.09%,基金跑赢基准7.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,通胀与经济增速将继续回落,市场焦点是宏观政策和流动性变化。宏观经济的触底回升及政策放松的幅度与节奏将成为下阶段市场走势预判中的核心。伴随着通胀超预期的消散,现有政策紧缩下的资产价格也已经呈现回落,流动性的环比改善不仅仅体现在紧缩政策的逐步微调,而且实体经济领域内的资金价格也会自发回落,盈利的周期性调整趋势有望在2012年一季度触底,而房地产调整的尚在可控和PPI的回落将使得企业盈利在2012年二季度之后趋于稳定,从通胀、流动性、盈利三者之于股市的筑底关联性来看,目前A股市场已经处于底部区域,我们对中国经济中长期的前景持相对乐观的判断,以上证180成长指数为代表的大盘蓝筹指数整体估值水平较低,处于历史底部,中长期的投资价值明显。

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,实现对上证180成长指数的有效跟踪。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人在报告期内对旗下基金估值中,各部门参与如下:

(一)基金会计:根据《基金会计核算业务指引》对基金日常交易进行记账核算,并对基金投资品种进行估值。

(二)金融工程部:对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况下,为估值提供相关模型。

(三)估值委员会:定期评价现行估值政策和程序,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。基金在采用新投资策略或投资新品种时,评价现有估值政策和程序的适用性。

(四)必要时基金经理参与估值政策制定、估值模型及估值方法的确定工作。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期亏损,未有应分未分的利润。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对上证180成长交易型开放式指数证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

安永华明会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:上证180成长交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日:2011年12月31日

单位:人民币元

资产			本期末 2011年12月31日
资产:			
银行存款			7,887,645.05
结算备付金			175,568.67
存出保证金			-
交易性金融资产			542,082,916.85
其中:股票投资			542,082,916.85
基金投资			-
债券投资			-
资产支持证券投资			-
衍生金融资产			-
买入返售金融资产			-
应收证券清算款			-
应收利息			803.08
应收股利			-
应收申购款			-
递延所得税资产			-
其他资产			-
资产总计			550,146,933.65
负债和所有者权益			本期末 2011年12月31日
负债:			
短期借款			-
交易性金融负债			-
衍生金融负债			-
卖出回购金融资产款			-
应付证券清算款			5,053,963.90
应付赎回款			-
应付管理人报酬			242,948.04
应付托管费			48,589.59
应付销售服务费			-
应付交易费用			842,039.55
应交税费			-
应付利息			-
应付利润			-
递延所得税负债			-
其他负债			240,000.00
负债合计			6,427,541.08
所有者权益:			
实收基金			616,754,441.00
未分配利润			-73,035,048.43
所有者权益合计			543,719,392.57
负债和所有者权益总计			550,146,933.65

注:(1)报告截止日2011年12月31日,基金份额净值0.882元,基金份额总额616,754,441.00份。

(2)本基金合同于2011年8月4日生效。

7.2 利润表

会计主体:上证180成长交易型开放式指数证券投资基金

本报告期:2011年8月4日至2011年12月31日

单位:人民币元

项目			本期 2011年8月4日(基金合同生效日)至2011年12月31日
一、收入			-74,134,763.88
1.利息收入			2,492,873.60
其中:存款利息收入			386,420.48
债券利息收入			70.68
资产支持证券利息收入			-
买入返售金融资产收入			2,106,382.44
其他利息收入			-
2.投资收益(损失以“-”填列)			-26,922,289.63
其中:股票投资收益			-27,140,329.54
基金投资收益			-
债券投资收益			4,229.32
资产支持证券投资收益			-
衍生工具收益			-
股利收益			213,810.59
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)			-49,744,790.85
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)			-
5.其他收入(损失以“-”号填列)			39,443.00
二、费用			3,269,129.18
1.管理人报酬			1,443,564.82
2.托管费			288,712.87
3.销售服务费			-
4.交易费用			1,212,006.13
5.利息支出			-
其中:卖出回购金融资产支出			-
6.其他费用			324,845.36
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)			-77,403,893.06
减:所得税费用			-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)			-77,403,893.06

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:上证180成长交易型开放式指数证券投资基金

本报告期:2011年8月4日至2011年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2011年8月4日(基金合同生效日)至2011年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	821,754,441.00	-	821,754,441.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-77,403,893.06	-77,403,893.06
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-205,000,000.00	4,368,844.63	-200,631,155.37
其中:1.基金申购款	342,000,000.00	-15,053,076.07	326,946,923.93
2.基金赎回款	-547,000,000.00	19,421,920.70	-527,578,079.30
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	616,754,441.00	-73,035,048.43	543,719,392.57

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

裴长江	黄小薏	张幸骏
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]496号《关于核准上证180成长交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》的核准,由华宝兴业基金管理有限公司作为发起人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《上证180成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责于2011年7月4日至2011年7月29日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2011)验字第60737318_B02号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2011年8月4日生效。本基金为股票型指数基金,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币821,736,841.00元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币17,600.00元,以上实收基金(本息)合计为人民币821,754,441.00元,折合821,736,841.00份基金份额。本基金的基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证180成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》等有关规定,本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象,指数化投资比例即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%,如因标的指数成份股调整、基金份额申购、赎回清单内现金替代、现金差额、基金规模或市场变化等因素导致基金投资比例不符合上述标准的,基金管理人将在10个交易日内进行调整。同时为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于新股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定,该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准为标的指数即上证180成长指数。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、《证券投资基金参与股指期货交易指引》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2011年12月31日的财务状况以及2011年8月4日(基金合同生效日)至2011年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2011年8月4日(基金合同生效日)起至2011年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项;

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具(主要系权证投资);

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等,以及不作为有效套期工具的衍生工具,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关的交易费用在发生时计入当期损益。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利,应当确认为当期收益。每日,本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益;

处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,同时调整公允价值变动收益;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该金融资产已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,该金融负债或其一部分将终止确认;

金融资产转移,是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方);本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债;

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资,股票投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账;

卖出股票于成交日确认股票投资收益,卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(2)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账,其中所包含的债券应收利息单独核算,不构成债券投资成本;

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,按上述会计处理方法核算;

卖出债券于成交日确认债券投资收益,卖出债券的成本按移动加权平均法结转;

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账;

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益,卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日,按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本,按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本;

上市后,上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算;

(5)回购协议

基金持有的回购协议(封闭式回购),以成本列示,按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次,第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的,以该报价为依据确定公允价值;第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价,或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的,以该报价为依据做必要调整确定公允价值;第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的,以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下:

1)股票投资

(1)上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(2)未上市的股票的估值

A.送股、转增股、公开增发新股或配股的股票,以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值;

B.首次公开发行的股票,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按其成本价计算;

首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值;

C.非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值:

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的初始取得成本时,采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值;

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的初始取得成本时,按中国证监会相关规定处理;

2)债券投资

(1)证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(2)证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日债券收盘净价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(3)未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本进行后续计量;

(4)在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值;

3)权证投资

(1)上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(2)未上市流通的权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本计量;

(3)因持有股票而享有的配股权证,采用估值技术确定公允价值进行估值;

4)分离交易可转债

分离交易可转债,上市日前,采用估值技术分别对债券和权证进行估值;自上市日起,上市流通的债券和权证分别按上述2)、3)中的相关原则进行估值;

5)其他

(1)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值;

(2)如有新增事项,按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算,并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示;

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额,扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在证券实际持有期内逐日计提;

(4)买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率),在回购期内逐日计提;

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账;

(6)债券投资收益/(损失)于成交日确认,并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(7)衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(8)股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(9)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(10)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1)基金管理费基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.5%年费率计提。

(2)基金托管费基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.1%年费率计提。

(3)标的指数许可使用费

本基金作为指数基金,需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付标的指数使用费。指数使用费按前一日的基金资产净值的0.03%的年费率计提。指数使用费每日计算,逐日累计。

计算方法如下:H=E×0.03%/当年天数

H为每日应付的指数许可使用费,E为前一日的基金资产净值。

指数使用费的收取下限为每季度人民币贰万伍仟元(25,000)。

标的指数供应商根据相应指数许可协议变更上述标的指数使用许可费费率和计费方式,基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前2日在指定媒体上刊登公告。

(4)卖出回购证券支出,按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;

(5)其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、每一基金份额享有同等分配权;

2、本基金收益分配采用现金方式;

3、在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配每年至多12次;每次基金收益分

配比例不得低于该次可供分配利润的10%。基金的收益分配比例以期末可供分配利润为基准计算。若基金合同生效不满三个月,收益可不分配;

4、当基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时,可进行收益分配;

5、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值;

6、法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

7.4.4.12 分部报告

无。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1.印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

2.营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

3.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定,自2005年6月13日起,对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得,按照财税[2005]102号文规定,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按50%计算应纳税所得额;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
“华宝兴业基金管理有限公司(“华宝兴业”)”	基金管理人、基金发起人
中国银行股份有限公司	基金托管人
华宝信托有限责任公司	基金管理人的主要发起人
领先资产管理有限公司	基金管理人的股东
宝钢集团有限公司	基金管理人的主要发起人的母公司
"华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金"	本基金的基金管理人管理的其他基金

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单位进行交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目		本期 2011年8月4日(基金合同生效日)至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费		1,443,564.82
其中:支付销售机构的客户维护费		-

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的0.5%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.5%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目		本期 2011年8月4日(基金合同生效日)至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费		288,712.87

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.1%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.1%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:人民币元

关联方名称	本期末 2011年12月31日			
			持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
宝钢集团有限公司			88,885,000.00	14.41%
华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金			324,378,110.00	52.59%

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年8月4日(基金合同生效日)至2011年12月31日			
			期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司			7,887,645.05	321,366.64

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.9 期末(2011年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购,因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购,因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	542,082,916.85	98.53
	其中:股票	542,082,916.85	98.53
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	8,063,213.72	1.47
6	其他各项资产	803.08	0.00
7	合计	550,146,933.65	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	35,748,853.40	6.57
C	制造业	159,007,573.83	29.24
C0	食品、饮料	49,649,761.40	9.13
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	2,716,487.55	0.50
C6	金属、非金属	31,395,202.06	5.77
C7	机械、设备、仪表	55,005,563.41	10.12
C8	医药、生物制品	20,240,559.41	3.72
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	9,477,108.27	1.74
E	建筑业	12,856,965.24	2.36
F	交通运输、仓储业	15,318,491.66	2.82
G	信息技术业	8,580,343.20	1.58
H	批发和零售贸易	4,306,230.60	0.79
I	金融、保险业	225,715,780.11	41.51
J	房地产业	27,291,675.98	5.02
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	498,303,022.29	91.65

8.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	5,519,358.90	1.02
C	制造业	32,389,358.98	5.96
C0	食品、饮料	5,714,434.00	1.05
C1	纺织、服装、皮毛	1,237,503.27	0.23
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	3,226,045.00	0.59
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	12,349,367.98	2.27
C7	机械、设备、仪表	9,862,008.73	1.81
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	1,700,080.00	0.31
J	房地产业	1,048,036.11	0.19
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	3,123,060.57	0.57
	合计	43,779,894.56	8.05

8.3 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

8.3.1 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	5,417,263	64,302,911.81	11.83
2	601328	交通银行	10,074,726	45,134,772.48	8.30
3	600000	浦发银行	4,922,116	41,788,764.84	7.69
4	601166	兴业银行	3,317,573	41,536,013.96	7.64
5	600519	贵州茅台	182,648	35,305,858.40	6.49
6	601288	农业银行	8,849,800	23,186,476.00	4.26
7	600031	三一重工	1,346,270	16,882,225.80	3.10
8	600048	保利地产	1,579,963	15,799,630.00	2.91
9	600887	伊利股份	702,100	14,343,903.00	2.64
10	600585	海螺水泥	882,562	13,812,095.30	2.54

8.3.2 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601989	中国重工	1,929,943	9,862,008.73	1.81
2	600362	江西铜业	359,110	7,875,282.30	1.45
3	600188	兖州煤业	246,510	5,519,358.90	1.02
4	600809	山西汾酒	60,500	3,819,970.00	0.70
5	600160	巨化股份	160,900	3,226,045.00	0.59

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于www.fsfund.com的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601328	交通银行	61,988,903.36	11.40
2	600036	招商银行	58,387,548.96	10.74
3	601166	兴业银行	57,348,791.10	10.55
4	600000	浦发银行	55,915,759.38	10.28
5	600519	贵州茅台	48,643,875.47	8.95
6	601288	农业银行	28,271,852.00	5.20
7	600031	三一重工	27,866,143.51	5.13
8	600111	包钢稀土	25,266,450.68	4.65
9	600048	保利地产	20,591,998.92	3.79
10	600547	山东黄金	20,403,597.66	3.75
11	600887	伊利股份	18,756,747.51	3.45
12	600104	上海汽车	17,854,360.33	3.28
13	600348	阳泉煤业	17,075,326.46	3.14
14	601699	潞安环能	16,255,424.60	2.99
15	600585	海螺水泥	15,569,499.39	2.86
16	600406	国电南瑞	14,710,832.76	2.71
17	600489	中金黄金	14,410,451.57	2.65
18	600383	金地集团	14,005,595.01	2.58
19	600518	康美药业	13,444,085.91	2.47
20	600089	特变电工	11,627,991.33	2.14
21	600068	葛洲坝	11,157,626.03	2.05

注:买入金额不包括相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	64,832,928.15	11.92
2	600585	海螺水泥	31,837,450.69	5.86
3	600089	特变电工	11,144,761.04	2.05
4	600674	川投能源	10,608,783.15	1.95
5	600383	金地集团	9,769,215.09	1.80
6	600123	兰花科创	6,719,482.73	1.24
7	600029	南方航空	5,326,170.64	0.98
8	600550	天威保变	3,330,813.24	0.61
9	600376	首开股份	3,263,297.94	0.60
10	600997	开滦股份	3,207,561.94	0.59
11	600395	盘江股份	3,089,138.28	0.57
12	600508	上海能源	2,457,601.82	0.45
13	600547	山东黄金	2,018,045.80	0.37
14	600528	中铁二局	1,638,276.94	0.30
15	601166	兴业银行	1,411,495.50	0.26
16	601328	交通银行	1,159,910.66	0.21
17	601607	上海医药	1,034,198.79	0.19
18	600000	浦发银行	1,025,752.52	0.19
19	600748	上实发展	1,021,013.80	0.19
20	600519	贵州茅台	815,901.84	0.15

注:卖出金额不包括相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	820,025,818.54
卖出股票收入(成交)总额	170,610,334.36

注:买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

8.5 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投资。

8.6 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。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	803.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	803.08

8.9.4 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。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.9.5.1 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。

8.9.5.2 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,374	259,795.47	521,671,773.00	84.58%	95,082,668.00	15.42%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国银行-华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金	324,378,110.00	52.59%
2	宝钢集团有限公司	88,885,000.00	14.41%
3	新华人寿保险股份有限公司	50,001,000.00	8.11%
4	中船重工财务有限责任公司	20,001,400.00	3.24%
5	国都证券-华夏-国都安心投资集合资产管理计划	10,000,400.00	1.62%
6	齐鲁证券有限公司	10,000,000.00	1.62%
7	上海万津实业有限公司	5,300,180.00	0.86%
8	新希望投资有限公司	4,991,263.00	0.81%
9	太平人寿保险有限公司-投连-银保	4,000,000.00	0.65%
10	翟秀英	3,500,000.00	0.57%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

本报告期末,基金管理人的从业人员未持有本基金。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2011年8月4日)基金份额总额	821,754,441.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	342,000,000.00
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	547,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	616,754,441.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人于2011年4月9日发布公告,聘任谢文杰先生为公司副总经理,其任职资格已经过中国证监会审核批准。
2、本报告期内,根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》,李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理。因工作调动,董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理,刘慧军女士不再担任中国银行托管及投资者服务部副总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金的投资策略在报告期内未发生变更。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所在本报告期的审计报酬为70,000.00元人民币。目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为:本基金合同生效之日(2011年8月4日)起至本报告期末。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人和托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
齐鲁证券	1	519,325,335.91	52.42%	441,426.18	52.42%	-
国信证券	1	471,310,816.99	47.58%	400,613.37	47.58%	-

注:1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下:

(1)选择标准:资力雄厚,信誉良好,注册资本不少于5亿元人民币;财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;经营行为规范,最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚;内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务;研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为本基金提供高质量的咨询服务,并能根据基金投资的特定要求,提供专门研究报告;适当的地域分散化。

(2)选择程序:(a)服务评价;(b)拟定备选交易单元;(c)签约。

2、本基金成立于报告期,所列交易单元均为新增。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
齐鲁证券	434,300.00	100.00%	5,934,300,000.00	68.33%	-	-
国信证券	-	-	2,750,000,000.00	31.67%	-	-

华宝兴业基金管理有限公司
2012年3月29日