1,175,568,249.15 1,175,568,249.15

## 华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金

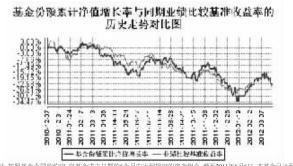
## 2012 第一季度 报告

	报告达出日期:2012年4月23日	
ſ	生、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: 袁规和投资组合报告等内容,保证复核内容不存 基金管理人承诺以诚实信用,勤勉尽责的原则	§1 重要提示 於料不存在應假记载、误导性除法或重大遗漏、并对其内容的真实 本基金合同规定、于2012年4月16日复核了本报告中的财务指标、净 管理和运用基金资产(但不保证基金一定盈利。 得理和运用基金资产(但不保证基金一定盈利。 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。
		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	2,587,699,367.70份
		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

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	2,587,699,367.70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 行业的辩识,精选以及对新兴产业相关处要职场。分析,挖细 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人期,结合 自下而上的个券选择方法构造储券投资组合。
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

基金托官人	中国建设银行股份有限公司
§3 主9 3.1 主要财务指标	要财务指标和基金净值表现
3.1 工资州为1日小	单位:人民产
主要财务指标	报告期(2012年1月1日 - 2012年3月31日 )
1.本期已实现收益	-141,594,790.6
2.本期利润	2,849,703.0
3.加权平均基金份额本期利润	0.001
4.期末基金资产净值	1,983,742,751.3
5.期末基金份额净值	0.766
	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
页,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价 2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或	值变动收益。 交易基金的各项费用,计人费用后实际收益水平要低于所列数字

	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						
	3.2.1 本报告	TATEL DATE OF THE PARTY	14 1 0 40 1 41 41 710	and the property of the property	1		
	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 0.91% 2.00% 2.10% 1.46% -1.19% 0.54*						0.54%	
	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						
	2010年12月7日 至 2012年3月31日)						



可规定的资产配置b 4.1 基金经理 f			4 管理人报告		
姓名	职务	任本基金的基 任职日期	金经理期限 离任日期	证券从业年限	说明
郭鹏飞	本基金基金宝金宝 公共 医克克克 医克克克克 医克克克克克克克克克克克克克克克克克克克克克克克克	2010年12月7日	1	8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 兴业新兴产业投票型证券 投资基金基金经理。

4.3.2 异常交易行为的专项说明 本报告期内,基金管理人未发生如下情况,所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边

4.4.2 报告期内基金的业绩表现 截近至本报告期末,本报告期内基金份额净值增长率为0.91%,基金基准涨幅为2.10%,基金表现落后于基准1.19

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2012年二季度,中国经济仍处于寻底过程中、企业盈利仍可能低于预期、政策放松力度会逐渐加大、A股短

期可能仍然难以选择明确的方向。经历了2011年的大幅度下跌后,部分经过市场检验的业绩优秀的新兴产业龙头公司投资价值显现,但由于扩客压力和大小丰率持压了的长期存在,成长股可能率以出现系统性估值提升的投资机会,只能依靠业绩的持续高速长力投资者来更好的回报。我们将继续坚持进行专业化投资,不参与传统行业投资以及短期交易性部兴产业中长期快速增长带来的丰厚回报。我们将继续坚持进行专业化投资,不参与传统行业投资以及短期交易性组会。专注于寻找新兴产业领域的中长期投资组会。希望中长期能够为持有人带来好的回报。
\$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 66)
1	权益投资	1,612,573,583.09	80.09
	其中:股票	1,612,573,583.09	80.09
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	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融 资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	399, 363, 480.30	19.83
6	其他资产	1,600,904.63	0.08
7	合计	2,013,537,968.02	100.00
_	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	27,221,561.78	1.37
В	采掘业	-	-
С	制造业	842,564,084.64	42.47
C0	食品、饮料	11,274,000.00	0.57
C1	纺织、服装、皮毛	39,016,584.00	1.97
C2	木材、家具	_	-
С3	造纸、印刷	11,690,259.93	0.59
C4	石油、化学、塑胶、塑料	160,662,432.40	8.10
C5	电子	76,625,254.07	3.86
C6	金属、非金属	_	-
C7	机械、设备、仪表	409,306,549.60	20.63
C8	医药、生物制品	119,355,397.24	6.02
C99	其他制造业	14,633,607.40	0.74
D	电力、煤气及水的生产和供应业	25,173,554.78	1.27
E	建筑业	123,446,098.89	6.22
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	198,837,260.01	10.02
Н	批发和零售贸易	107,255,115.50	5.41
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	266,099,749.89	13.41
L	传播与文化产业	21,976,157.60	1.11
M	综合类	_	-
	合计	1,612,573,583.09	81.29
5.3	报告期末按公允价值占基金资产净值比	比例大小排序的前十名股票投资明细	
1	1		トセムシをさらななけしか

		台口	1	,612,5/3,583.09	81.29		
5.3	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(段)	公允价值 玩)	占基金资产净值比例 %)		
1	300070	碧水源	3,117,327	118,146,693.30	5.96		
2	300257	开山股份	1,223,586	68,276,098.80	3.44		
3	300124	汇川技术	1,448,863	67,560,481.69	3.41		
4	002503	捜于特	2,015,412	67,314,760.80	3.39		
5	000826	桑德环境	3,050,457	66,560,971.74	3.36		
6	002358	森源电气	2,114,080	49,976,851.20	2.52		
7	002310	东方园林	530,391	48,170,110.62	2.43		
8	300105	龙源技术	1,041,499	41,993,239.68	2.12		
9	300005	探路者	2,007,053	39,940,354.70	2.01		
10	002313	日海通讯	904 148	38 634 244 04	1.95		

10 002313 日海加讯 904,148 38,634,244.04 18 4 报告期末末被缔告品种分类的债券投资组合 本基金本报告期末末特有债券投资。
5.3 报告期末末按允余价值占基金资产争值比例大小排名的前五名债券投资明细 本基金本报告期末末转有债券投资。
5.6 报告期末未按分余价值占基金资产争值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 本基金本报告期末末转有资产支持证券。
5.7 报告期末按公允价值占基金资产争值比例大小排名的前五名权证投资明细 本基金本报告期末按允允价值占基金资产单值比例大小排名的前五名权证投资明细 本基金本报告期末按公允价值占基金资产

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 編制目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。

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	1,261,695.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	94,475.31
5	应收申购款	244,733.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,600,904.63
本基金	报告期末持有的处于转股期的可转 全本报告期末未持有处于转股期的可 报告期末前十夕股票由左左逐通受	「转换债券。

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受 <b>\$6</b> 尹	を限情况。 F放式基金份额变动	
•		单位:份
本报告期期初基金份额总额		2,870,031,286.23
本报告期基金总申购份额		65,453,264.96
减:本报告期基金总赎回份额		347,785,183.49
本报告期基金拆分变动份额		-

2,587,699,367.70 报告期期末基金份额必测 注:总申购份额含红利再投资和转换人份额;总赎回份额含转换 §7 备查文件目录

7.1 备查文件目录中国正监会批准基金设立的文件; 华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金合同; 华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金招赛说用书; 华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金招赛说用书; 华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金行管协议; 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。

72. 并如尼西 以上文件存于基金管理人及基金托管人办公厕所由以内出土。 73. 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。 华奎兴业基金管理有限公司 2012年4月23日

## 华宝兴业先进成长股票型证券投资基金

## 2012 第一季度 报告

#### 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送出日期:2012年4月23日

本报告中财务资料未经审计。 本报告期自2012年1月1日起至3月31日止。 82 基金产品概况

基金简称	华宝兴业先进成长股票
基金主代码	240009
交易代码	240009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月7日
报告期末基金份额总额	934,446,592.12份
投资目标	分享我国经济增长方式转变过程中和转变完成后的先进企业 的成长,在控制风险的前提下为基金份额持有人谋求长期超额 回报。
投资策略	本基金将使用定量与定性相结合的方法,选择具备创新能力 强;注重资源节约与环境友好,充分发挥人力资源优势这三个 先进因素之一的企业进行投资,重点关注国家产业结构调整中 鼓励类行业,同时也兼顾有先进企业的传统行业。
业绩比较基准	新上证综指收益率。
风险收益特征	本基金是一只积极型的股票投资基金,属于证券投资基金中的 较高风险品种。
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

主要财务指标	报告期(2012年1月1日 - 2012年3月31日 )
.本期已实现收益	-135,023,724.70
.本期利润	-39,186,567.56
加权平均基金份额本期利润	-0.0416
.期末基金资产净值	1,343,765,168.53
.期末基金份额净值	1.4380
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值;	· 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企业产生的企业。 4. 本期利润为本期已实现设益加上本期公允价值变动收益。 2. 所述基金址销售标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计人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 全级企场企业运动企业。 1 中线比较基准收益的 1 中线比较基准收益。 阶段 
 净值增长率①
 净值增长率标准
 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

#### 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的



4.1 基金经理 向			4 管理人报告		
姓名	职务	任本基金的基金经理期限		22.44.11.11.72.09	234 00
处土石	現六9子	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
李靖	本基金基金经理	2011年2月11日	-	12年	博士 1996年至2000年任 和居创业协设存得於与简单 第月、2000年至2010年在 大上证券有限公司集合任 行业研究员、策略研究员、 投资经理报证可理制部副 总经理的职务。2010年7月 加入年22火业基金管理员 选股票型证券投资基金等 经实现的原务。2010年9月 2012年1月任华宝火业行业情 法股票型证券投资基金等 集级进取报。2011年2月起 集绩整整理,2011年2月起 集结企业是是是是一个企业。

等差异。分核资类别 戲票。债券 的收益率差异以及连续出了手及羽型。

4.32 异常交易行为的专项说明
本报告期内。基金管理人未发生工作情况,所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边
交易量超过远证券当日皮全量的5%。
本报告期内。基金管理人未发生更常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运输类型。

4.4 报告期内基金投资策略和运输类型。

6.4 报告期内基金投资策略和运输关系。

6.5 中一季度市场经过短暂下採后发力上攻。先期是银行率先发力,发起攻击。随后煤炭和有色行业一改去年的
颓废,带领期期及类周期行业。强劲上攻,市场走出一绝较强劲的行情。市场经过一番上攻后,随者对二季度经济复苏
的环境。及常税通胀发据不理境的消息,市场又出现了大幅回路。市场经现强被动现象。
由于持续的经济增强的服务的规划是被制度,但整个经济也还是处于一个快速下滑的过程中,通胀已经出现了明显回路。而通胀进一步的回路将为央行提供一定的货币宽於条件。虽接近低部。但到底走出也型还是市场分基础的运输,市场对经济复苏的时间强身从大行强化。但整个发现的大价等和发展,包围上在人员已定,这也为本轮皮型的适了条件。市场对经济复苏的时间强明从二季度拖延到一季度,加剧了市场的忧虑,同时一季报公司和问超预期的行业不

8. 也导致了市场出现大幅回调。

本基金一季度在配置上比较均衡,但在消费品上的配置较小,但后期也增加了美块配置,以保持组合的均衡性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现。

本基本。平民(正正正上上1478798),社会上177878日 442 报告期内基金的业绩表现 截止至本报告期末,本报告期基金份额净值增长率为-2.88%,比较基准收益率为2.89%,基金表现落后于基准

5.77%。 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 目前情况来看。三季度有可能出现一个经济调整的低点、所以经济增速和企业盈利趋势的下降所带来的向下压制作用以及经济前康和废资改善的向上推动将共同作用在二季度,虽将使得指数在低位造成波动,但是全年看来应是良好的投资点位。

# 股市的底部是要依靠经济自身出清的速度因素。但是具体拐点仍要看中央政策。目前来看,自2009年以来的此轮 经济调整正更多来自于经济自身因素调整、收黄有避免再次干预过度的想法)。这个出清的第一次时间点有可能会在 下半年完成,而以及其结束的具体时间点按束于中央政府对实际情况的判断和效策。中央政策需密以上 国内政策将逐渐转间正面。无论是中央投资还是货币政策。都在向越来越多保增长的方向在转变;政策效果将逐 步署积、最后从量变到恢变。 从FED模型来看,目前,配的股票和债券收益率差距已经按近1664点的水平,而如果未未流动性改善收益率下 序开始,3那么股将明确进入一轮上涨大周期,就较长期而言。目前A股的确具备良好的投资价值。 \$5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

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	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融 资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	178,354,506.56	13.06
6	其他资产	11,561,909.86	0.85
7	合计	1,365,484,665.57	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	21,619,000.00	1.61
В	采掘业	133,528,578.24	9.94
C	制造业	728,492,079.81	54.21
C0	食品、饮料	51,803,346.60	3.86
C1	纺织、服装、皮毛	8,589,728.37	0.64
C2	木材、家具	4,217,015.04	0.31
C3	造纸、印刷	_	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	75,492,213.04	5.62
C5	电子	76,892,816.65	5.72
C6	金属、非金属	49,323,884.35	3.67
C7	机械、设备、仪表	256,392,039.82	19.08
C8	医药、生物制品	205,781,035.94	15.31
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	
E	建筑业	25,814,690.10	1.92
F	交通运输、仓储业	9,804,375.76	0.73
G	信息技术业	54,435,458.06	4.05
Н	批发和零售贸易	26,859,000.66	2.00
I	金融、保险业	124,427,715.58	9.26
J	房地产业	34,852,991.54	2.59
K	社会服务业	15,522,184.40	1.16
L	传播与文化产业	212,175.00	0.02
M	综合类	-	-
	合计	1,175,568,249.15	
	<b>担生期土地八朵价估上其个次产店估</b>	1. (a) L	

5.3	报告期末按公允的	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	002001	新和成	3,710,480	73,467,504.00	5.47
2	600216	浙江医药	2,523,827	53,631,323.75	3.99
3	002049	晶源电子	2,847,469	50,912,745.72	3.79
4	000527	美的电器	3,499,979	45,919,724.48	3.42
5	600312	平高电气	5,365,017	44,529,641.10	3.31
6	002497	雅化集团	2,877,474	41,924,796.18	3.12
7	600079	人福医药	1,899,890	34,217,018.90	2.55
8	000400	许继电气	1,991,331	32,438,781.99	2.41
9	000800	一汽轿车	2,670,965	28,071,842.15	2.09
10	600157	永泰能源	1,621,062	26,552,995.56	1.98
5.4	担生胡士拉佛类口	抽公米的债券仍次组	<u> </u>		

5.4 报告期未被债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期未被债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期未被允价估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五名债券投资明细
本基金本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效正。
5.7 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,也没有在报告编制目前一年内
5.8.1 报告期内本基金投资的前子名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制目前一年内
5.8.2 本基金股票投资的主要对象是先进企业股票,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设有值租基金合同规定的股票。基金管理人建立有基金股票备选库。本报告期内本基金的
6.5.8.3 其他资产构成 844,568.17 10,472,160.22 垃收股利 161,991.58

48,209.9 待摊费用 11,561,909.86

单位:份949,188,600.99 4,936,831.10 19,678,839.93 934,446,592.12

至至15日人 7.2 存放地点 以上文件存于基金管理人及基金托管人住所备投资者查阅。

7.2 存成形態。 以上文件存于基金管理人及基金托管人住所卻按照有 且 Pu。 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。 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 2012年4月23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:2012年4月23日

报告读出明:2012年4月23日 基金管理人的董事会及董事保证本报告所裁资料不存在虚假记载、误导性除述或重大遗漏,并对其内容的真实 性、推确性和完整性承租分别及连带责任。 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2012年4月6日复核了本报告中的财务指标、净值表现和联资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载,误导性除述或者重大遗漏。 基金管理人承诺以该求信用、勤股支势的原则管理和应用基金资产。但不保证基金一定盈利。 基金管理人承诺以该求信用、勤股支势的原则管理和应用基金资产。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。

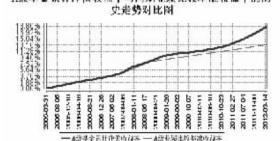
基金简称	华宝兴业现金宝货币	华宝兴业现金宝货币		
基金主代码	240006			
交易代码	240006			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2005年3月31日			
报告期末基金份额总额	2,336,057,049.93份			
投资目标	保持本金的安全性与流动性	生,追求高于比较基准的收益率。		
投资策略	期、收益性以及信用等级的	以对宏观经济及利率走势的判断为基础,在满足组合平均久期,收益性以及信用等级的前提下利用现代金融分析方法和工具,优化组合配置效果,实现组合增值。		
业绩比较基准	同期7天通知存款利率 悦后	同期7天通知存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中 风险和预期收益率都低于服	中高流动性、低风险的品种,其预期 设票、债券和混合型基金。		
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司	1		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	7		
下属两级基金的基金简称	华宝兴业现金宝货币A	华宝兴业现金宝货币B		
下属两级基金的交易代码	240006	240007		
报告期末下属两级基金的份额总额	441,140,122.82份	1,894,916,927.11份		
§3 3.1 主要财务指标	主要财务指标和基金净值表现			
3.1 工类型为自由机		单位:人民市		
主要财务指标	报告期(2012年1月1日 - 2012年3月31日)			

		単位:人民市
主要财务指标	报告期 (2012年1月1	日 - 2012年3月31日 )
	华宝兴业现金宝货币A	华宝兴业现金宝货币B
1.本期已实现收益	5,816,938.03	29,960,849.68
2.本期利润	5,816,938.03	29,960,849.68
3.期末基金资产净值	441,140,122.82	1,894,916,927.11
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收页,本期利润为本期已实现收益加上本期公元	价值变动收益。由于货币市场基金	

但受动以益为零, 本期已头地收益和本期和阻的金额相等。 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, 计人费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净 3.2.1 本报台		直收益率及其与同期 华宝	用业绩比较基准收 兴业现金宝货币/			
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	1.2263%	0.0032%	0.3705%	0.0000%	0.8558%	0.0032%
注:基金收益	益分配是按日结转		兴业现金宝货币I	3		
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	1.2869%	0.0032%	0.3705%	0.0000%	0.9164%	0.0032%

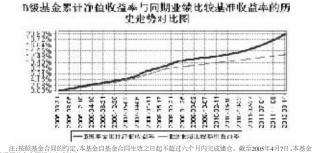
A級基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历



## 华宝兴业现金宝货币市场基金

## 2012 第一季度 报告

2012年3月31日



根据基金合同	司规定完成建仓	٥			
4.1 基金经	理 成基金经理	小组 )简介	§4 管理人报	告	
姓名	职务	任本基金的	基金经理期限	证券从业年	说明
处土石	RT.93	任职日期	离任日期	限	19099
陈昕	理	2011年11月15 日	-	8年	经济学学士. 2003年7月加入华宝 火业基金管理有限公司,先后在湾 寶登记部,交易部,固定收益部从 事固定收益产品相关的估值,交 易,投资工作。2010年7月起任华宝 兴业现金宝货币市场基金基金约 理助理。2011年11月至今任华宝兴 业现金宝货币市场基金基金经理
		甚金运作遵规守任			
本报告期	力.本基金管理/	【 遵守 (	·   北和国证券法》	仲华人民共和	D国证券投资基金法 WS 其各项字施约

就告期內,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、依市市场基金管理哲行办法》、作宝决业观金宝货币市场基金基金目,和走他书法律法期的报法的主动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 △平交易专项战界

率差异。分投资类别、偿要、债券、的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下间向交易的交易价差。分析结果未发现非常称。
1.2 异常交易广为的专项说明
本程告期内,基金管理人米发生如下情况,所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边
交易量超过效征券当日成交量的3%。
本报告期内,基金管理人米发生如下情况,所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边
交易量超过效征券当日成交量的3%。
4.4 报告期内基金的投资额积证或非分析。
4.4 报告期内基金的投资额积证实于分析。
4.4 报告期内基金的投资额积证实于分析。
4.5 报告期内基金的投资额积证实于分析。
4.5 报告期内基金的投资额积益等表现资格。
发并不明显。新增外汇占款以及银行存款的增长之力使得货币供应量以及信贷投放的水平明显偏低,有鉴于此,为了
实现货币或货值格,引导流动性米平超向自建助橡妆态。共行于2月下旬,调查水准金量—2次、不见来行放化的态度和下条价值用当截值和缓慢。期间,货币市场收益率受到奉节因素于找出现定期度复,但在除在原则出现趋势性下
接不流流的皮部的增加,后用随表则固定扩升和产品,而其中又以中联等数信用预分据。
报告期内,本基金为影到决行资度逐步放松将导致未来货币市场收益率逐步下行,为将组合收益尽量长地维持
往投资从平、缓解后使用投资压力,本基金主要增加了中低等数是明确。

在250元平。 28年后珠冉投领比力,本基金主要增加了中低等极短期融资券及定期存款投资,并相应拉长了维各平均 纳余期限。 4.42 报告期内基金的业绩表现 明7天通知序统利率 银行。 期7天通知序统利率 银行。 第一张企业各本金融告期内份额净值收益率为1.2869%,同期业绩比较基准收益率为0.3705%,业绩比较基准为同 期7天通知序统利率 银行。 4.5 管理人对安观经济。 证券市场及行业走势的高要展望 在经历了 左手四季度以及今年一季度的利率债。信用确轮动行情后,债券市场有可能将进人相对平流的休整时 期,流边性改善的推动已是一段落。收益率虽然仍有下行空间,但在缺乏新的较强促发因素的情况下。清在的整体或 高级能设务受到期间。相较利率倾而意。信用简约有价值度高,仍然是紧伸起对被函数关注重点。当然。化不能因为海 龙CCP的到明兄付而放松雪梯。信用风险的控制是基本削损。 下一阶段、本基金将继续对宏观经济以及货币政策的运向保持紧密跟踪,并适时进行投资组合调整,力争为投资 者获取更高的回报。

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	631,294,400.96	26.43
	其中:债券	631,294,400.96	26.43
	资产支持证券	_	
2	买人返售金融资产	_	
	其中:买断式回购的买人返售金 融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,735,130,807.10	72.65
4	其他资产	21,962,185.82	0.93
5	合计	2,388,387,393.88	100.0
5.2 打	设告期债券回购融资情况		
序号	项目	占基金资产	争值的比例 %)
1	报告期内债券回购融资余额		1.29
	其中:买断式回购融资		0.0
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	49,999,805.00	2.14
	其中:买断式回购融资	-	-
33. IF	生期内佛类同酌融资全额上其全边	8产海信的比例为报告期内每日融资	· 余额占资产净值比例的简单平均

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况 在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180 月 5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

5期限资产占基金资产 值的比例 %) 各期限负债占基金资 净值的比例 %) 序号 平均剩余期限 17.12 60天 含)-907 20.59 90天 含 -180 51.79

	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债			-	-
5	180天 含 )-397天 含 )			11.57	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利	率债		-	-
	合计			101.30	2.14
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		181,097,241.65		7.75
	其中:政策性金融债		181,097,241.65		7.75
4	企业债券		-		-
5	企业短期融资券		450,197,159.31		19.27
6	中期票据		-		-
7	其他		-		_
8	合计		631,294,400.96		27.02
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券		50,660,463.76		2.17

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	带券投资明细	
序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本 忨)	占基金资产净值比 例 %)
1	070211	07国开11	800,000	80,180,143.96	3.43
2	041160017	11鲁商CP001	700,000	70,010,073.58	3.00
3	070219	07国开19	500,000	50,256,633.93	2.15
4	041154017	11北大荒 CP004	500,000	50,034,633.80	2.14
5	1181375	11中铝业CP03	500,000	49,983,303.39	2.14
6	041159003	11北电CP001	400,000	39,990,921.28	1.71
7	090205	09国开05	300,000	30,496,460.85	1.31
8	041164010	11天山水泥 CP001	300,000	30,026,746.52	1.29
9	041153002	11华能CP002	300,000	29,987,064.63	1.28
10	000407	007:4207	200,000	20, 164, 002,01	0.04

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	10
报告期内偏离度的最高值	0.2682%
报告期内偏离度的最低值	0.0634%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2164%

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

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买人成本列示,按照票面利率或商定利率并考虑其买人时的溢价与 折价,在剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益 5.8.2 本报告期内,本基金不存在持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本

5.8.3 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

	· 大人罚。	
5.8.4	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	应收利息	21,577,771.89
4	应收申购款	384,413.93
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	21,962,185.82

§	6 开放式基金份额变动	
		单位:
项目	华宝兴业现金宝货币A	华宝兴业现金宝货币B
本报告期期初基金份额总额	617,704,111.34	4,054,172,889.16
本报告期基金总申购份额	743,076,256.08	3,170,179,471.75
减:本报告期基金总赎回份额	919,640,244.60	5,329,435,433.80
本报告期期末基金份额总额	441,140,122.82	1,894,916,927.11

§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; 华宝兴业现金宝货币市场基金基金合同; 华宝兴业现金宝货币市场基金招募说明书:

华宝兴业现金宝货币市场基金托管协议; 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。 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会