华宝兴业先进成长股票型证券投资基金

2012 第二季度 报告

2012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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2012年7月18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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年7月12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2012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	914,145,356.56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

§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(2012年4月1日 - 2012年6月30日)
1.本期已实现收益	-75,480.590.04
2.本期利润	123,267,507.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.1343
4.期末基金资产净值	1,436,428,561.91
5.期末基金份额净值	1.5713

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。

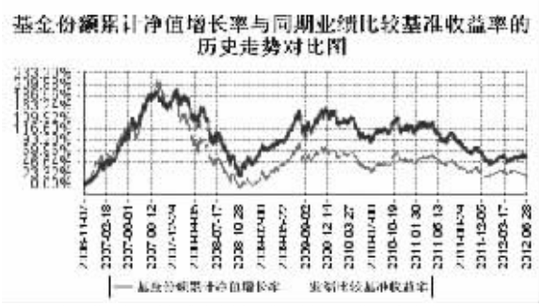
3.2 基金净值表现

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	9.27%	1.09%	-1.69%	0.96%	10.96%	0.13%

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

(2006年11月7日 至 2012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5月7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		
李靖	本基金基金经理	2011年2月11日	-	12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2012年1月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。
朱亮	本基金基金经理	2012年6月1日	-	6年	硕士。曾于倍多科技(中国)有限公司任产品总监,于国金证券股份有限公司任研究员。2008年7月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后任研究部高级分析师、国内投资部华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理助理,华宝兴业宝康消费品证券投资基金基金经理助理,华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金经理助理,2012年6月至今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、《华宝兴业先进成长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,基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制,确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时,基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求,分析了本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差;分析结果未发现异常情况。

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该证券当日成交量的5%。

本报告期内,本基金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

今年二季度市场在经过前期较大的调整后出现了一波较好的涨幅。以地产、及装饰建材等行业为主的行业,配以金改主要主题的券商及各类金融主题版块表现活跃,带动大盘上涨。

随着地产调控继续的政策出台,地产包括前期活跃的券商出现版块性的调整,带动大盘开始调整。这个过程中医药及泛消费行业逐渐走强,体现了较好的防御功能。

二季度,随着市场对欧洲问题的担心,以及国内政策的不明朗,市场出现系统性的宽幅震荡,市场结构分化极度严重,结构性机会和风险非常明显。

本基金在二季度基本保持组合均衡,前期增配了地产、券商等行业,获利逐渐减持后增加了医药和消费的配置,仓位保持在中等偏上的水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止至本报告期末,本报告期内基金份额净值增长率为9.27%,比较基准收益率为-1.69%,基金表现领先比较基准10.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来的市场,我们认为国内通胀问题基本不用担心,经济调整的方向、速度和力度的匹配仍然是困扰市场的主要因素。国际市场上,欧洲问题仍然是一个巨大的定时炸弹,即便短期解除警报,也是一个相当长的修复过程,美联储货币政策导向以及欧洲问题仍将导致市场产生一定的波动。下一阶段,主要配置还需围绕着能够防御的大消费板块以及科技进步板块、政策支持的成长板块上精选个股,波段操作。

§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	1,191,125,347.66	82.42
	其中:股票	1,191,125,347.66	82.42
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	227,764,613.86	15.76
6	其他资产	26,310,021.80	1.82
7	合计	1,445,199,983.32	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	493,000.00	0.03
B	采掘业	32,200,898.26	2.24
C	制造业	742,622,612.04	51.70
C0	食品、饮料	73,113,136.73	5.09
C1	纺织、服装、皮毛	55,848,981.30	3.89
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	41,675,124.26	2.90
C5	电子	113,533,908.69	7.90
C6	金属、非金属	28,705,483.51	2.00
C7	机械、设备、仪表	129,855,973.51	9.04
C8	医药、生物制品	299,890,004.04	20.88
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	81,496,261.74	5.67
F	交通运输、仓储业	7,575,202.65	0.53
G	信息技术业	92,288,902.02	6.42
H	批发和零售贸易	35,617,945.76	2.48
I	金融、保险业	23,368,759.16	1.63
J	房地产业	77,191,798.58	5.37
K	社会服务业	65,869,255.98	4.59
L	传播与文化产业	32,328,511.47	2.25
M	综合类	72,200.00	0.01
	合计	1,191,125,347.66	82.92

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	002001	新和成	3,710,480	78,402,442.40	5.46
2	002049	晶源电子	2,847,469	63,071,438.35	4.39
3	600079	人福医药	2,004,890	46,493,399.10	3.24
4	002497	雅化集团	2,877,474	38,817,124.26	2.70
5	000538	云南白药	500,000	29,640,000.00	2.06
6	601888	中国国旅	999,863	28,216,133.86	1.96
7	002384	东山精密	2,380,705	27,140,037.00	1.89
8	600809	山西汾酒	719,484	27,117,351.96	1.89
9	600239	云南城投	3,099,793	26,317,242.57	1.83
10	002422	科伦药业	549,929	25,659,687.14	1.79

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 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	1,059,743.36
2	应收证券清算款	25,152,539.46
3	应收股利	-
4	应收利息	47,047.26
5	应收申购款	50,691.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,310,021.80

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

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	002049	晶源电子	63,071,438.35	4.39	重大资产重组
2	300212	易华录	5,798,162.24	0.40	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	934,446,592.12
报告期期间基金总申购份额	18,902,923.16
减:报告期期间基金总赎回份额	39,204,158.72
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	914,145,356.56

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;

华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金合同;

华宝兴业先进成长股票型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业先进成长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住所备投资者查阅。

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
2012年7月18日

华宝兴业现金宝货币市场基金

2012 第二季度 报告

2012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:2012年7月18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2012年7月12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2012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	3,203,809,409.12份	
投资目标	保持本金的安全性与流动性,追求高于比较基准的收益率。	
投资策略	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(税后)	
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都低于股票、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	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
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	1,029,876,541.58份	2,173,932,867.54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(2012年4月1日 - 2012年6月30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	9,534,196.22	28,117,434.92
2.本期利润	9,534,196.22	28,117,434.92
3.期末基金资产净值	1,029,876,541.58	2,173,932,867.54

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。由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝兴业现金宝货币A

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	1.0727%	0.0031%	0.3642%	0.0001%	0.7085%	0.0030%

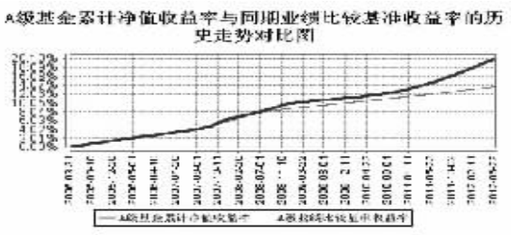
注:基金收益分配是按日结转份额。

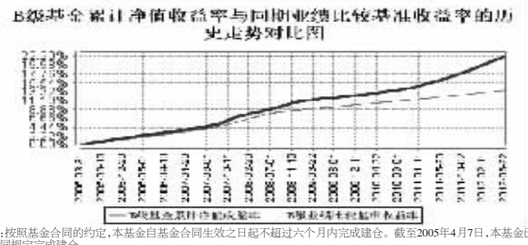
华宝兴业现金宝货币B

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	1.1325%	0.0031%	0.3642%	0.0001%	0.7683%	0.0030%

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

(2005年3月31日 至 2012年6月30日)





注:按照基金合同的约定,本基金自基金合同生效之日起不超过六个月内完成建仓。截至2005年4月7日,本基金已根据基金合同规定完成建仓。

§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		
陈昕	本基金基金经理、华宝短融50基金基金经理	2011年11月15日	-	8年	经济学学士。2003年7月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后在清算登记部、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经理助理,2011年11月至今任华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理,2012年6月至今兼任华宝兴业中证短融50指数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、《货币市场基金管理暂行办法》、《华宝兴业现金宝货币市场基金基金合同》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,基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制,确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时,基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求,分析了本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差;分析结果未发现异常情况。

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该证券当日成交量的5%。

本报告期内,本基金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

本季度内,宏观经济增长与通胀呈现出双降态势,货币政策继续微调步伐,除再度降准外,基准利率在市场翘首以待中于6月初次下调。债券市场受到较多积极因素支撑,表现良好,利率债走势较一季度明显改善,信用债则继续强势,不过市场也并非始终一马平川,自6月中旬起市场开始走弱,多数品种出现较为明显的调整。

报告期内,本基金考虑到央行货币政策整体基调仍是逐步放松,未来货币市场收益率中枢水平继续下行的趋势明显,从绝对收益水平以及信用利差的角度出发,大类资产配置中,本基金主要增加了中低等级短期融资券投资,并将组合平均剩余期限保持在较长的水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

现金宝A:本基金报告期内净值收益率为1.0727%,同期业绩比较基准收益率为0.3642%,业绩比较基准为同期7天通知存款利率(税后)。

现金宝B:本基金报告期内净值收益率为1.1325%,同期业绩比较基准收益率为0.3642%,业绩比较基准为同期7天通知存款利率(税后)。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

自6月以来债券市场开始出现的调整并不意味着慢牛行情的终结,不过随着货币政策放松的边际效用逐步递减,未来市场的走势可能更多体现为双向波动。三季度尚看不到对债券市场有明显负面作用的因素产生,不过由于信用利差已经回归到历史均值以下,因此在新债供给压力有所放大的情况下,信用债投资的风险需要加强关注。

下一阶段,本基金将继续对宏观经济以及货币政策的动向保持紧密跟踪,做好预判,并适时进行投资策略和资产组合调整,力争为投资者获取良好回报。

§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	1,706,506,861.09	48.73
	其中:债券	1,706,506,861.09	48.73
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	1,733,626,270.71	49.50
4	其他资产	61,799,366.68	1.76
5	合计	3,501,932,498.48	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.73	
	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	295,499,308.75	9.22
	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

在本报告期内本货币市场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	158
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	159
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	106

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

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 天。

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	3.23	9.22
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	27.78	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	21.27	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.10	-
4	90天(含)-180天	17.50	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	37.59	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	107.38	9.22

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	431,915,234.74	13.48
	其中:政策性金融债	431,915,234.74	13.48
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,274,591,626.35	39.78
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,706,506,861.09	53.26
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	131,386,685.07	4.10

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	120218	12国开18	2,500,000	250,401,736.70	7.82
2	090407	09农发07	1,000,000	100,914,161.44	3.15
3	041259024	12苏豪CP001	1,000,000	100,410,925.60	3.13
4	041254017	12华侨城CP002	1,000,000	100,016,134.48	3.12
5	041160017	11鲁商CP001	700,000	70,006,665.87	2.19
6	041260026	12乌兰煤炭CP001	600,000	60,394,798.51	1.89
7	041258022	12营口港CP001	600,000	60,267,030.06	1.88
8	041253026	12东阳光CP001	600,000	60,246,154.58	1.88
9	041161014	11中公用CP002	500,000	50,473,336.25	1.58
10	070219	07国开19	500,000	50,126,812.97	1.56

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	32
报告期内偏离度的最高值	0.4149%
报告期内偏离度的最低值	0.1986%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2690%

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 本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,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超过当日基金资产净值20%的情况。

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到公开谴责、处罚。

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	41,615,610.34
4	应收申购款	20,183,756.34
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	61,799,366.68

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华宝兴业现金宝货币A	华宝兴业现金宝货币B
报告期期初基金份额总额	441,140,122.82	1,894,916,927.11
报告期期间基金总申购份额	2,386,140,261.20	3,708,237,857.25
减:报告期期间基金总赎回份额	1,797,403,842.44	3,429,221,916.82
报告期期末基金份额总额	1,029,876,541.58	2,173,932,867.54

注:总申购份额含份额级别调整、转换入份额和红利再投;总赎回份额含份额级别调整和转换出份额。

§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。

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
2012年7月18日

华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金

2012 第二季度 报告

2012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:2012年7月18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2012年7月12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2012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	2,520,939,788.02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(2012年4月1日 - 2012年6月30日)
1.本期已实现收益	-34,795,347.83
2.本期利润	238,032,570.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.0936
4.期末基金资产净值	2,168,305,671.71
5.期末基金份额净值	0.8601

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。

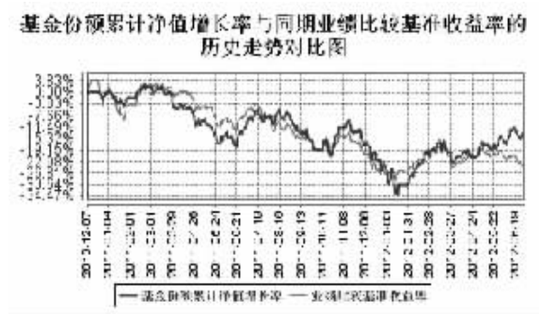
3.2 基金净值表现

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	12.20%	1.10%	1.31%	0.91%	10.89%	0.19%

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	国内投资部总经理、本基金基金经理、华宝兴业宝康配置混合基金经理	2010年12月7日	-	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,2012年4月起任国内投资部总经理。

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

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制,确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时,基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求,分析了本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差;分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交