

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

2012 年第二季度报告

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监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、完整性和及时性承担个别及连带责任。
基金托管人中国建设银行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。

本报告期自2012年4月1日起至2012年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金基本情况		华宝兴业上证180成长ETF联接
基金代码	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	2011年8月1日	
报告期末基金份额总额	186,172,267.48份	
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	本基金为日终T+1到账的指数基金，主要通过投资于日终T+1到账的ETF以达到投资目标。当本基金持有的现金比例大于或等于16%时，同期上证180指数收益率为0.48%，基金表现领先业绩比较基准1.18%。本基金的现金比例大于或等于10%时，同期上证180指数收益率为0.07%，年化跟踪误差为1.22%。	
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	

2.2 目标基金基本情况		华宝兴业上证180成长ETF
基金名称	510280	
基金代码	510280	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年8月1日	
基金销售上市的证券交易所	上海证券交易所	
基金管理人名称	华宝兴业基金管理有限公司	
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司	
目标基金投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。	
目标基金投资策略	本基金为日终T+1到账的指数基金，主要通过投资于日终T+1到账的ETF以达到投资目标。当本基金持有的现金比例大于或等于16%时，同期上证180指数收益率为0.48%，基金表现领先业绩比较基准1.18%。本基金的现金比例大于或等于10%时，同期上证180指数收益率为0.07%，年化跟踪误差为1.22%。	
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		报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)
主要财务指标		单位:人民币元
1.本期已实现收益	663,850.30	
2.本期利润	3,930,020.21	
3.期初至报告期期末的利润总额	181,970,496.20	
4.期末基金净值	0.977	

注:1.本基金管理费收入为2011年8月1日至2012年6月30日止,截至报告日基金合同尚未满一年。 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金组合,截至2012年2月9日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。	
--	--

§4 管理人报告		报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)
姓名	职务	任本基金的基金经理期间
余海燕	基金经理	2011年8月9日
	任职日期	2011年8月9日
	离任日期	6年
	说明	

4.1 基金经理(基金经理助理)简介		报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)
姓名	职务	任本基金的基金经理期间
余海燕	基金经理,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-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	2011年8月9日
	任职日期	-
	说明	

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明		报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)
本报告期内,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》及其他各项法律法规的规定,履行诚实守信、勤勉尽责的义务,不存在损害基金持有人利益的行为。		
本报告期内,基金管理人通过严格执行投资决策委员会会议规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统的公平交易制度、每日交易报告制度、定期基金净值披露制度和公平交易的合规操作,严格执行投资决策委员会会议规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统的公平交易制度、每日交易报告制度、定期基金净值披露制度和公平交易的合规操作,确保所管理的所有投资组合在研究分析、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和基金合同,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人争取最大利益,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会议规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统的公平交易制度、每日交易报告制度、定期基金净值披露制度和公平交易的合规操作,确保所管理的所有投资组合在研究分析、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和基金合同,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人争取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。		
4.3.2 公平交易执行情况		
本报告期内,基金管理人通过严格执行投资决策委员会会议规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统的公平交易制度、每日交易报告制度、定期基金净值披露制度和公平交易的合规操作,确保所管理的所有投资组合在研究分析、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和基金合同,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人争取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。		

4.4 管理人对本基金运作遵规守信情况的说明		报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)
本报告期内,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》及其他各项法律法规的规定,履行诚实守信、勤勉尽责的义务,不存在损害基金持有人利益的行为。		
本报告期内,基金管理人通过严格执行投资决策委员会会议规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统的公平交易制度、每日交易报告制度、定期基金净值披露制度和公平交易的合规操作,确保所管理的所有投资组合在研究分析、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和基金合同,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人争取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。		
4.5 管理人对本基金运作的特别说明		
本报告期内,基金管理人通过严格执行投资决策委员会会议规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统的公平交易制度、每日交易报告制度、定期基金净值披露制度和公平交易的合规操作,确保所管理的所有投资组合在研究分析、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和基金合同,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人争取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。		

4.6 管理人对本基金运作的特别说明		报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)
本报告期内,基金管理人通过严格执行投资决策委员会会议规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统的公平交易制度、每日交易报告制度、定期基金净值披露制度和公平交易的合规操作,确保所管理的所有投资组合在研究分析、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和基金合同,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人争取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。		
4.7 会计政策		
本报告期内,基金管理人通过严格执行投资决策委员会会议规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统的公平交易制度、每日交易报告制度、定期基金净值披露制度和公平交易的合规操作,确保所管理的所有投资组合在研究分析、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和基金合同,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人争取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。		
4.8 报表的批准		
本报告期内,基金管理人通过严格执行投资决策委员会会议规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统的公平交易制度、每日交易报告制度、定期基金净值披露制度和公平交易的合规操作,确保所管理的所有投资组合在研究分析、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和基金合同,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人争取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。		

4.9 报告期内本基金未持有处于转股期的可转换债券		报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)
本报告期内,本基金未持有处于转股期的可转换债券。		
4.10 报告期内本基金未持有处于质押状态的股票		
本报告期内,本基金未持有处于质押状态的股票。		
4.11 报告期内本基金未持有处于冻结状态的股票		
本报告期内,本基金未持有处于冻结状态的股票。		

4.12 报告期内本基金未持有处于转股期的可转换债券		报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)
本报告期内,本基金未持有处于转股期的可转换债券。		
4.13 报告期内本基金未持有处于质押状态的股票		
本报告期内,本基金未持有处于质押状态的股票。		
4.14 报告期内本基金未持有处于冻结状态的股票		
本报告期内,本基金未持有处于冻结状态的股票。		

4.15 报告期内本基金未持有处于转股期的可转换债券		报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)
本报告期内,本基金未持有处于转股期的可转换债券。		
4.16 报告期内本基金未持有处于质押状态的股票		
本报告期内,本基金未持有处于质押状态的股票。		
4.17 报告期内本基金未持有处于冻结状态的股票		
本报告期内,本基金未持有处于冻结状态的股票。		