

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

重要提示及目录

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构... 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...

2.1 基金基本情况
基金名称: 华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金
基金代码: 510000

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采用完全复制法跟踪标的指数的表现...

2.3 基金管理人及基金托管人
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

3.1 主要财务指标和基金净值表现
3.1.1 期间回报数据指标
3.1.2 期末回报数据指标
3.1.3 累计净值增长率

3.2 基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较
基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

3.3 基金业绩评价
基金业绩评价小组及其基金业绩评价简介

4.1 基金管理人及基金经营情况
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验
4.1.2 基金管理人基金从业经历

4.2 基金经理
基金经理: 徐小明
基金经理: 陈建华

4.3 基金管理人内部控制制度的专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
4.3.2 基金管理人内部控制制度的专项说明

4.4 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业绩表现的说明

4.5 报告期内基金投资组合的重大变动
4.5.1 报告期内基金投资组合的重大变动

4.6 报告期内基金持有人户数及持有结构
4.6.1 报告期内基金持有人户数及持有结构

4.7 报告期内基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
4.7.1 报告期内基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

4.8 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
4.8.1 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

4.9 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
4.9.1 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

4.10 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
4.10.1 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

4.11 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
4.11.1 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

4.12 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
4.12.1 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

4.13 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
4.13.1 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

4.14 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
4.14.1 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

4.15 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
4.15.1 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

4.16 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
4.16.1 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

4.17 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
4.17.1 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

4.18 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
4.18.1 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

4.19 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
4.19.1 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

4.20 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
4.20.1 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

4.21 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
4.21.1 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

4.22 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
4.22.1 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

4.23 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
4.23.1 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

4.24 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
4.24.1 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

4.25 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
4.25.1 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

4.26 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
4.26.1 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

4.27 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
4.27.1 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

4.28 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
4.28.1 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

4.29 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
4.29.1 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

4.30 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
4.30.1 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

4.31 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
4.31.1 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

4.32 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
4.32.1 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金

2012 半年度 报告摘要

2012年6月30日

截止本报告期末, 根据相关法律法规及基金合同的约定, 本基金本报告期无应分配尚未实施的利润。

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2012年上半年, 本基金托管人严格按照《证券投资基金法》和《证券投资基金托管业务管理办法》等法律法规及基金合同的约定, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责履行了基金托管人应尽的义务。

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

2012年上半年, 华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金的基金管理人—华宝兴业基金管理有限公司, 严格按照《证券投资基金法》和《证券投资基金托管业务管理办法》等法律法规及基金合同的约定, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责履行了基金托管人应尽的义务。

5.3 托管人对半年度报告中基金净值计算、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人(即华宝兴业基金管理有限公司)根据《证券投资基金法》和《证券投资基金托管业务管理办法》等法律法规及基金合同的约定, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责履行了基金托管人应尽的义务。

5.4 基金管理人、基金托管人履行各自职责的情况

根据《证券投资基金法》和《证券投资基金托管业务管理办法》等法律法规及基金合同的约定, 基金管理人、基金托管人履行各自职责的情况如下:

6.1 资产负债表

截止2012年6月30日, 本基金资产净值2,262.26亿元, 基金份额净值2.262元, 基金份额总额444,028,726,000份。

6.2 利润表
截止2012年6月30日, 本基金本期实现净利润1,138,906,406.41元, 归属于基金份额持有人的净利润1,138,906,406.41元。

6.3 所有者权益变动表
截止2012年6月30日, 本基金本期所有者权益合计1,138,906,406.41元。

6.4 现金流量表
截止2012年6月30日, 本基金本期经营活动产生的现金流量净额为1,138,906,406.41元。

6.5 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.1 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.2 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.3 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.4 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.5 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.6 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.7 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.8 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.9 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.10 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.11 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.12 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.13 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.14 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.15 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.16 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.17 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.18 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.19 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.20 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.21 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.22 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.23 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.24 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.25 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.26 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.27 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.28 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.29 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.30 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.31 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.32 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.33 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.34 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.35 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.36 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.37 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.38 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.39 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.40 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.41 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.42 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.43 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.44 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.45 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.46 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.47 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.48 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.49 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.50 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.51 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.52 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.53 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

6.5.54 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
6.5.55 基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况

先的9%调整为6%;
6.2.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

6.2.2 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况
6.2.3 本报告期与关联方发生的关联交易情况

6.2.4 关联方关系
6.2.5 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

6.2.6 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况
6.2.7 本报告期与关联方发生的关联交易情况

6.2.8 关联方关系
6.2.9 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

6.2.10 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况
6.2.11 本报告期与关联方发生的关联交易情况

6.2.12 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.13 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.14 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.15 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.16 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.17 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.18 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.19 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.20 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.21 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.22 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.23 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.24 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.25 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.26 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.27 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.28 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.29 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.30 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.31 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.32 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.33 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.34 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.35 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.36 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.37 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.38 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.39 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.40 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.41 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.42 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.43 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.44 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.45 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.46 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.47 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.48 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.49 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.50 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.51 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.52 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.53 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.54 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.55 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.56 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.57 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.58 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.59 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.60 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.61 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.62 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.63 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.64 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.65 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.66 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.67 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.68 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.69 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.70 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.71 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

6.2.72 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.2.73 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变更的情况

7.3 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
7.3.1 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 columns: 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(%)

注: 投资者欲了解本报告期内基金投资中指数投资的所有股票明细, 应阅读刊载于www.fund.com.cn的半年度报告正文。

7.3.2 期末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

Table with columns: 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(%)

注: 投资者欲了解本报告期内基金投资中积极投资的所有股票明细, 应阅读刊载于www.fund.com.cn的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动
7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 买入金额不包括相关交易费用。

7.4.3 买入金额前5名股票及卖出金额前5名股票的投资人名称

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 买入金额不包括相关交易费用。

7.4.4 买入金额前5名股票及卖出金额前5名股票的投资人名称

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 买入金额不包括相关交易费用。

7.4.5 买入金额前5名股票及卖出金额前5名股票的投资人名称

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 买入金额不包括相关交易费用。

7.4.6 买入金额前5名股票及卖出金额前5名股票的投资人名称

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 买入金额不包括相关交易费用。

7.4.7 买入金额前5名股票及卖出金额前5名股票的投资人名称

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 买入金额不包括相关交易费用。

7.4.8 买入金额前5名股票及卖出金额前5名股票的投资人名称

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 买入金额不包括相关交易费用。

7.4.9 买入金额前5名股票及卖出金额前5名股票的投资人名称

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 买入金额不包括相关交易费用。

7.4.10 买入金额前5名股票及卖出金额前5名股票的投资人名称

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 买入金额不包括相关交易费用。

7.4.11 买入金额前5名股票及卖出金额前5名股票的投资人名称

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注: 买入金额不包括相关交易费用。

7.4.12 买入金额前5名股票及卖出金额前5名股票的投资人名称

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)