华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金

2012年度报告摘要

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
送出日期:2013年3月27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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年3月22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。

本报告中的财务资料已经审计,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。

本报告期自2012年01月01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	华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华宝兴业上证180价值ETF
基金主代码	510030
交易代码	510030
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2010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	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	420,528,726.00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	2010年5月28日

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价值指数
风险收益特征	本基金为股票基金,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。本基金在股票基金中属于指数基金,紧密跟踪标的指数,属于股票基金中风险较高、收益与标的指数所代表的股票市场水平大致相近的产品。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	赵会军
	联系电话	021-38505888	010-66105799
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-700-5588,021-38924558	95588
传真		021-38505777	010-66105798
注册地址		上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心58楼	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心58楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		郑安国	姜建清

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	2012年	2011年	2010年4月23日(基金合同生效日)-2010年12月31日
本期已实现收益	-96,060,006.70	-105,133,563.23	-150,392,143.47
本期利润	166,375,775.33	-250,661,327.74	-204,652,555.79
加权平均基金份额本期利润	0.3334	-0.4675	-0.3597
本期加权平均净值利润率	14.89%	-18.82%	-13.74%
本期基金份额净值增长率	16.46%	-14.84%	-12.56%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配利润	-254,307,276.10	-390,420,364.30	-159,546,586.02
期末可供分配基金份额利润	-0.6047	-0.7457	-0.3676
期末基金资产净值	1,065,345,773.25	1,138,906,400.61	1,108,333,693.01
期末基金份额净值	2.533	2.175	2.554
3.1.3 累计期末指标	2012年末	2011年末	2010年末
基金份额累计净值增长率	-13.28%	-25.54%	-12.56%

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、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。
4、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	20.05%	1.28%	19.72%	1.27%	0.33%	0.01%
过去六个月	11.98%	1.16%	11.24%	1.15%	0.74%	0.01%
过去一年	16.46%	1.15%	13.60%	1.14%	2.86%	0.01%
目基金合同生效日起至今	-13.28%	1.35%	-14.91%	1.34%	1.63%	0.01%

注:1、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)。
2、本基金业绩比较基准为:上证180价值指数。
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: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2010年5月28日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

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

注:本基金合同于2010年4月23日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金成立于2010年4月23日,截至本报告期末,本基金未进行过利润分配。

§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(2012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180价值ETF、上证180价值ETF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、华宝兴业医药生物基金、华宝短融50基金、华宝兴业资源优选基金和华宝添益基金,所管理的开放式证券投资基金资产净值合计37,660,892,995.57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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
徐林明	本基金基金经理、华宝兴业中证100指数基金经理、华宝兴业上证180价值ETF联接基金经理、量化投资部总经理	2010年4月23日	-	10年	复旦大学经济学硕士,FRM,曾在兴业证券、凯龙财经(上海)有限公司、中原证券从事金融工程研究工作。2005年8月加入华宝兴业基金管理有限公司,曾任金融工程部数量分析师、金融工程部副总经理。2009年9月起任华宝兴业中证100指数型证券投资基金基金经理。2010年2月起任量化投资部总经理,2010年4月起兼任华宝兴业上证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。
陈建华	本基金基金经理助理、华宝兴业上证180价值ETF联接基金基金经理助理、华宝兴业上证180成长ETF基金经理助理、华宝兴业上证180成长ETF联接基金经理助理、华宝兴业中证100指数基金经理	2011年6月28日	2012年12月31日	11年	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,先后在研究部、量化投资部任助理分析师、数量分析师、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,兼任华宝兴业上证180成长ETF、华宝兴业上证180成长ETF联接基金经理助理,2012年12月起任华宝兴业中证100指数型证券投资基金基金经理。

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、《上证180价值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 公平交易制度和控制方法

基金管理人从研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节出发制定了公司内部的公平交易制度以确保公司所有投资组合在各个环节得到公平的对待。公平交易制度和控制方法适用公司管理所有投资组合(包括公募基金、特定客户资产管理组合),对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

研究分析方面,公司使用统一的投资研究管理系统,并规定所有与投资业务相关的研究报告和投资人库信息必须在该系统中发表和存档,同时,该系统对所有投资组合经理设置相同的使用权限。

授权和投资决策方面,投资组合经理在其权限范围内的投资决策保持独立,并对其投资决策的结果负责。通过各个系统的权限设置使投资组合经理仅能看到自己的组合信息。

交易执行方面,所有投资组合的投资指令必须通过交易系统分发和执行,对于交易所公开竞价交易,交易系统内置公平交易执行程序,公司内部通过制度规定此类交易指令需执行公平交易程序,由交易部负责人负责执行,针对其他不能通过系统执行公平交易程序且必须以公司名义统一进行交易的指令,公司内部制定相关制度流程以确保此类交易的公允分配。同时,公司根据法规要求在交易系统中设置一系列投资禁止与限制指标对公平交易的执行进行事前控制,主要包括限制公司旗下组合自身及组合间反向交易、对敲交易、银行间买断式交易等。

事后监管,公司的风险管理部作为独立第三方对所有投资行为进行事后监督,主要监督的事项包括以下内容。

1) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析。

2) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合所有交易所二级市场交易进行1日、3日、5日同向交易价差分析。

3) 对公司管理的不同投资组合的所有银行间债券买卖和回购交易进行分析,监督的内容包括以下几点,同一投资组合短期内对同一债券的反向交易,债券买卖到期收益率与中债估值的收益率之间的差异,回购利率与当日市场平均利率之间的差异。对上述监督内容存在异常的情况要求投资组合经理进行合理性解释。

4) 对非公开发行股票申购,以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程的公允性进行监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

2012年全年基金管理人严格遵守公司内部制定的公平交易制度和控制方法,确保了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。公司内部制定的公平交易制度涉及的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

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,分析了公司旗下所有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;并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下(1日、3日、5日)同向交易的样本,对其进行95%置信区间的假设检验分析,同时结合各组合的成交金额,并参考市场成交量等因素综合判断是否存在不公平交易、利益输送的可能。分析结果未发现异常情况。

4.3.3 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 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

一季度在流动性出现改善背景下A股市场出现了一波快速反弹,二、三季度国内经济增速持续下滑超预期、通胀继续回落、银行续新准备率不差不足、企业盈利不断下降导致国内A股市场连续半年多的持续阴跌。四季度随着业绩超预期的指数PMI、发电量增速等宏观经济领先指标纷纷转暖,以及出国内宏观经济出现了复苏迹象;十八大顺利召开、国家新、老领导人顺利交接,稳定和改善政策预期,2012年最后一个月,在上证指数跌至全年最低点1949点之后,在金融、房地产等周期股带领下,市场强劲反弹。回顾2012年全年,沪深300指数和上证180价值指数分别上涨7.55%和13.60%,中小板指数和创业板指数分别下跌1.38%和12.14%,大盘价值股领涨市场。

本报告期本基金为正常运作期,在操作中,我们严格遵守基金合同,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

截至本报告期末,本基金份额净值为2.533元,本报告期基金份额净值增长率为16.46%,同期业绩比较基准收益率为13.60%。本报告期内本基金的日均跟踪偏离度的绝对值为0.03%,年化跟踪误差为0.88%。

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,我们认为全球经济形势比2012年有所好转,美国"财政悬崖"危机化解,经济继续呈现缓慢复苏,欧洲下滑势头有望趋缓。中国经济依靠基建投资、出口好转和低库存而企稳,受益于刺激性红利和城镇化进程,投资者对经济前景的预期将逐渐明朗;十八大的胜利召开,政治领导人换届之后的新气象,新作风,在坚持改革背景下对经济发展将出台更多政策支持,增加投资者对未来经济前景的信心;另外,部分信托和理财产品出现的兑付风险,正在逐渐降低投资者的无风险收益率的预期水平,在此背景下,股票资产的相对吸引力正在提高。如宏观经济逐步确定步入复苏期,股票资产无疑是最佳的资产配置类别。

在管理层及市场各方越来越关注资本市场投资功能的背景下,以金融、煤炭为主的低估值价值股构成的上证180价值指数近2年来持续表现优异,价值股表现了持续的超额收益,市场趋势的变化值得投资者重视。

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价值指数的有效跟踪。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司自2003年3月成立以来始终注重合规性和业务风险控制,加强对基金运作的内部操作风险控制、保障基金份额持有人的利益始终是公司制定各项内部制度、流程的指导思想。公司监察稽核部门对公司遵守各项法规和管理制度及公司所管理的各基金履行合同义务的情况进行核查,发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改,同时定期向监管部门、公司管理层及上级公司出具相应报告。

本报告期内,基金管理人内部监察稽核主要工作如下:

(一)规范员工行为操守,加强职业道德教育和风险教育。公司通过对新员工集中组织岗前培训、签署《个人声明书》等形式,明确员工的行为准则,防范道德风险。

(二)完善公司制度体系。公司一方面坚持制度的刚性,不轻易改变、简化已确立的流程。要求从一般员工、部门经理到业务总监、每个人都必须清楚自己的权力和职责,承担相应责任。另一方面,伴随市场变革和产品创新,公司的业务和管理方式也发生着变化,在长期的业务实践中,公司借鉴和吸收海外股东、国内同行经验,在符合公司基本制度的前提下,根据业务的发展不时调整、充许各级员工在职责范围内设计和调整自己的业务流程,涉及其它部门或领域的,由相应级别的负责人在符合公司已有制度的基础上协调和批准。公司根据业务情况调整和细化了市场、营运、投资研究各方面的分工和业务规则,并根据内部控制委员会和监察稽核部门提出的意见、建议调整或改善了前、中、后台的业务流程。

(三)有重点地全面开展内部审计稽核工作。2012年,监察稽核部门按计划对公司营运、投资、市场部门进行了业务审计,并与相关部门进行沟通,形成后续跟踪和业务上相互促进的良性循环,不断提高工作质量。

在今后的工作中,本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念,完善内控制度,提高工作水平,努力防范和控制各种风险,保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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过程中,公司内部参与估值流程的各方职责分工如下:

(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)量化投资部: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,根据估值委员会对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法(比如:指数收益法)进行估值,并在估值时兼顾考虑行业研究员提供的根据上市公司估值模型计算的结果所提出的建议或意见。

(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)必要时基金经理就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见,但由估值委员会做最终决策。

上述参与估值流程的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力,参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

§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

(一)本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间:0

(二)该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间:0

附:数量区间为0、0至10万份(含)、10万份至50万份(含)、50万份至100万份(含)、100万份以上。

§10 开放式基金份额变动

	单位:份
基金合同生效日(2010年4月23日)基金份额总额	2,109,182,935.00
本报告期期初基金份额总额	523,528,726.00
本报告期基金总申购份额	435,500,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	538,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	420,528,726.00

§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

本报告期内,本基金管理人、本基金托管人和基金托管部门未发生重大人事变动。

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、基金财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(2010年4月23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	
中银万国	1	273,523,063.21	76.59%	243,063.41	76.97%	-
中信证券	1	83,613,768.69	23.41%	72,722.33	23.03%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

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、本期未新增席位。

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
中银万国	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

华宝兴业基金管理有限公司
2013年3月27日

2012年12月31日

2012年,本基金托管人在对华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地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,华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金的管理人——华宝兴业基金管理有限公司在华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对华宝兴业基金管理有限公司编制和披露的华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金2012年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、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:华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资产:			
银行存款		4,249,675.70	3,138,305.44
结算备付金		10,136.12	108.31
存出保证金		-	-
交易性金融资产		1,062,065,681.16	1,133,574,912.06
其中:股票投资		1,062,065,681.16	1,133,574,912.06
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		231,177.54	3,874,163.49
应收利息		794.22	575.14
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,066,557,464.74	1,140,588,064.44
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		442,391.26	491,415.39
应付托管费		88,478.28	98,283.08
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		243,063.41	666,669.26
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		437,758.54	425,296.10
负债合计		1,211,691.49	1,681,663.83
所有者权益:			
实收基金		1,228,444,217.12	1,529,326,764.91
未分配利润		-163,098,443.87	-390,420,364.30
所有者权益合计		1,065,345,773.25	1,138,906,400.61
负债和所有者权益总计		1,066,557,464.74	1,140,588,064.44

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额净值2.533元,基金份额总额420,528,726.00份。

7.2 利润表

会计主体:华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一.收入		174,355,833.82	-240,693,624.76
1.利息收入		24,072.38	31,028.28
其中:存款利息收入		24,072.38	30,060.91
债券利息收入		-	967.37
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-88,080,516.12	-94,936,889.72
其中:股票投资收益		-120,076,008.55	-122,720,355.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	419,860.63
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		31,995,492.43	27,363,605.34
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		262,435,782.03	-145,527,764.51
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		-23,504.47	-259,998.81
二.费用		7,980,058.49	9,967,702.98
1.管理人报酬		5,615,077.93	6,637,622.91
2.托管费		1,123,015.53	1,327,524.55
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		534,355.83	1,212,551.14
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		707,609.20	790,004.38
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)		166,375,775.33	-250,661,327.74
减:所得税费用		-	-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)		166,375,775.33	-250,661,327.74

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012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)	1,529,326,764.91	-390,420,364.30	1,138,906,400.61
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	166,375,775.33	166,375,775.33
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)	-300,882,547.79	60,946,145.10	-239,936,402.69
其中:1.基金申购款	1,272,178,149.64	-286,863,959.05	985,314,190.59
2.基金赎回款	-1,573,060,697.43	347,810,104.15	-1,225,250,593.28
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)	1,228,444,217.12	-163,098,443.87	1,065,345,773.25

项目	上年度可比期间 2011年1月1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)	1,267,880,279.03	-159,546,586.02	1,108,333,693.01
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-250,661,327.74	-250,661,327.74
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)	261,446,485.88	19,787,549.46	281,234,035.34
其中:1.基金申购款	2,978,152,982.97	-291,127,062.22	2,687,025,920.75
2.基金赎回款	-2,716,706,497.09	310,914,611.68	-2,405,791,885.41
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)	1,529,326,764.91	-390,420,364.30	1,138,906,400.61

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:

裘长江 黄小蕾 张来骏

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价值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[2010]227号《关于核准华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》的核准,由基金管理人华宝兴业基金管理有限公司依据《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价值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向社会公开发行募集。首次设立募集金额总额为人民币2,109,182,935.00元(含募集股票市值),业经安永华明(2010)验字第60737318_B04号验资报告予以验证。经中国证监会备案,《上证180价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2010年4月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,109,182,935份基金份额。本基金为交易型开放式,存续期限不定。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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证180价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》等有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括上证180价值指数的成份股及其备选成份股、新股(首次公开发行或增发)、债券、以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具;法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资于上证180价值指数的成份股和备选成份股的资产比例不低于该基金资产净值的95%;同时为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,该部分资产比例不高于基金资产净值的5%;本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;本基金在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的0.5%,基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。

本基金会计核算遵循财政部颁布的企业会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定(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>》、《证券投资基金季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2012年12月31日的财务状况以及2012年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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