华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金

【2012】第四季度报告

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21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2013年1月16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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业医药生物
基金主代码	240020
交易代码	240020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年2月28日
报告期末基金份额总额	234,245,077.83份
投资目标	把握医药生物相关行业的长期增长,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,决定大类资产配置比例。通过对医药生物相关行业的辨识、精选以及对医药生物行业相关股票的深入分析,挖掘该类型企业的投资价值。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	80%×中证医药卫生指数+20%×上证国债指数
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较高预期风险和预期收益的品种,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
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

§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10月1日 - 2012年12月31日)
1.本期已实现收益	973,075.66
2.本期利润	2,094,905.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.0093
4.期末基金资产净值	261,425,347.17
5.期末基金份额净值	1.116

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	0.72%	1.10%	0.68%	0.97%	0.04%	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
(2012年2月28日至2012年12月31日)

注:1、本基金基金合同生效于2012年2月28日,截止报告日本基金基金合同生效未满一年。

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产组合,截至2012年8月28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		
范红兵	本基金基金经理、华宝兴业大盘精选基金经理	2012年2月28日	-	12年	硕士。曾在南方证券股份有限公司、中新苏州工业园创业投资有限公司和平安证券股份有限公司从事证券研究、风险投资工作。于2007年7月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后任高级分析师、基金经理助理。2009年2月至2010年9月任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理,2010年7月起任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理,2012年2月起兼任华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金基金经理。
王智慧	研究部总经理、本基金基金经理、华宝兴业大盘精选基金经理	2012年2月28日	-	11年	管理学博士。曾在中国国际金融有限公司、上海申银万国证券研究所、浙江龙盛集团、国元证券有限公司从事投资研究工作。2009年8月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后任研究部副总经理、投资经理、基金经理助理的职务,现任研究部总经理,2012年1月至今任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金的基金经理,2012年2月起兼任华宝兴业医药生物优选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、《华宝兴业医药生物优选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

本报告期内,因受到国内实体经济下滑,投资不振和房地产调控政策的延续背景下,沪深指数前半段继续延续前期下跌的弱势运行,创出了近四年来的新低,后半段在受到中央十八大选出新一届领导者以及新领导者的南方考察和一些领域讲话精神积极刺激下,大盘走出了逼空的行情,医药行业指数也跟随大盘从11月初的快速大幅下跌后到年末的止跌反弹。由于本轮的反弹主要是以低价蓝筹股启动,消费内需型的板块表现相对较弱。医药行业指数表现无明显的超额收益。

本基金在此期间以优化个股投资权重为主,仓位小幅调整为辅的投资策略。采取上述投资策略主要基于:首先是政策方面中性偏多,发改委药品降价靴子落地,抗肿瘤、免疫系统和血液系统用药降价幅度好于预期;大病医保相关政策出台,对特色专科药企业形成一定利好;部分地方的非基药招标更加强化药品质量,有利于优势大企业等。其次是行业运营数据方面增速略有回升,盈利水平保持稳定。2012年1-8月医药行业收入同比增长19.05%,实现利润总额同比增长18.31%。由于招标降价压力趋缓,预计未来行业收入和利润增速都将呈现缓慢回升态势。本基金在投资选股优化方面主要集中在低估值的一线蓝筹股和低估值的成长股中,聚焦有资源优势、品牌优势、创新优势等龙头企业。与此同时对今年内全年超跌但公司基本面在2013年有可能转好的一些股票也积极加以关注,适当均衡配置可能在2013年更有成效。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末,本报告期内基金份额净值增长率为0.72%,业绩比较基准收益率为0.68%,基金表现领先比较基准0.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012年的二、三季度国内制造业实体行业数据不断恶化,出口不振,中央对经济政策已转变为稳增长,同时我们看到近期的采购经理人指数已出现短期止跌回稳的迹象,企业去库存和PPI出现了积极的信号,考虑到11月8日十八大召开,以及2013年3月两会召开和政府换届,短期政策维稳姿态明显,近期央企和上市公司的增持、回购股票以及央行流动性释放等等,市场最悲观的情况可能过去。证券市场在未来一段时间在指数严重超跌的背景下,短期的估值修复可能会发生,行情的演绎可能在周期性股票和稳定增长类股票间交替演绎。

行业投资策略:目前医药板块累积了可观绝对或超额收益,但医药行业需求刚性和持续性特征,预计重点上市公司全年业绩趋势较为明朗,稳定的业绩增长尤其是和其他行业的比较优势明显,仍有望支撑其相对大盘的估值溢价和相对收益,但我们估计年内主升浪已过去。业绩增长可靠的优质股有望迎来估值切换,获取时间换空间的中线收益。由于对新一届领导群体的期盼和中国经济内生性增长的实际潜力判断,结合目前国内股市中的大盘蓝筹股整体估值水平的不高,我们认为未来一段时间股市的正面向上动能还在。

本基金未来投资策略将集中在优化持仓结构,继续重点持有发展格局清晰、业绩增长明确、估值合理的细分领域龙头公司,与此同时对今年内全年超跌但公司基本面在2013年有可能转好的一些股票也积极加以关注,适当均衡配置可能在2013年更有成效。

§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	217,845,875.36	81.51
	其中:股票	217,845,875.36	81.51
2	固定收益投资	9,987,000.00	3.74
	其中:债券	9,987,000.00	3.74
	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	31,383,425.74	11.74
6	其他资产	8,037,210.12	3.01
7	合计	267,253,511.22	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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	182,547,275.81	69.83
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	6,215,756.47	2.38
C8	医药、生物制品	176,331,519.34	67.45
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	3,786,681.90	1.45
H	批发和零售贸易	31,511,917.65	12.05
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	217,845,875.36	83.33

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	600557	康缘药业	764,196	15,895,276.80	6.08
2	000028	国药一致	360,677	12,731,898.10	4.87
3	000963	华东医药	370,559	12,599,006.00	4.82
4	600436	片仔癀	112,104	12,210,367.68	4.67
5	002038	双鹭药业	308,486	12,203,706.16	4.67
6	000423	东阿阿胶	294,885	11,916,302.85	4.56
7	600518	康美药业	860,000	11,300,400.00	4.32
8	600521	华海药业	761,120	8,676,768.00	3.32
9	600276	恒瑞医药	275,771	8,300,707.10	3.18
10	600535	天士力	145,536	8,043,774.72	3.08

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	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	9,987,000.00	3.82
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	9,987,000.00	3.82

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1001060	10央行票据60	100,000	9,987,000.00	3.82

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 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 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	169,985.64
2	应收证券清算款	7,647,427.25
3	应收股利	-
4	应收利息	132,900.70
5	应收申购款	86,896.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,037,210.12

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	229,248,827.13
本报告期基金总申购份额	80,417,911.86
减:本报告期基金总赎回份额	75,421,661.16
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	234,245,077.83

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;
华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金基金合同;
华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金招募说明书;
华宝兴业医药生物优选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办公场所各投资者查阅。

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
2013年1月21日

华宝兴业行业精选股票型证券投资基金

【2012】第四季度报告

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21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2013年1月16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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业行业精选股票
基金主代码	240010
交易代码	240010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年6月14日
报告期末基金份额总额	12,703,673,009.50份
投资目标	把握行业发展趋势和市场运行趋势,精选增长前景良好或周期复苏的行业和企业,在控制风险的前提下,追求基金净值的稳定增长和基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将通过分析宏观经济、产业政策和行业景气程度,精选发展前景良好或景气程度向好的行业,通过行业估值模型与波特五力分析,加强对有吸引力行业的配置。在行业配置比例确定后,本基金将对基金管理人股票库相关精选行业的股票运用定量指标筛选排名靠前的股票,并进行定性分析,确定最终投资组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率。
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10月1日 - 2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-250,474,285.49
2.本期利润	436,737,467.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.0348
4.期末基金资产净值	11,267,307,234.94
5.期末基金份额净值	0.8869

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。

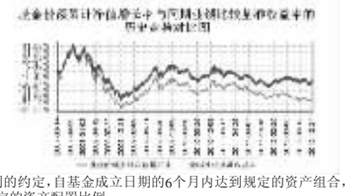
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	4.07%	1.02%	10.02%	1.28%	-5.95%	-0.26%

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
(2007年6月14日至2012年12月31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12月14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		
任志强	公司副总经理、投资总监、本基金基金经理	2007年9月7日	-	15年	硕士。1995年3月至1997年3月就职于上海市外高桥保税区开发(控股)公司期货部;1997年4月至1999年2月任职于中国南方证券有限公司,从事证券研究工作。1999年3月至2006年10月在华宝信托投资有限责任公司工作,曾担任研究员、研发中心总经理助理、研发中心总经理、投资管理部总经理、公司总裁助理、公司董事会秘书等职务。2006年10月至2007年8月任华宝证券经纪有限公司董事、副总经理。2007年8月加入华宝兴业基金管理有限公司,任投资总监,2007年9月至今兼任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理,2009年6月任命为公司副总经理。
蒋宁	投资副总监、本基金基金经理	2010年7月3日	-	17年	硕士。1995年至1996年任职于上海万国证券公司证券投资总部从事证券研究工作,1996年至2010年3月任职于申银万国证券公司证券投资及金融衍生品总部从事证券投资研究工作。2010年4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7月至今任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理,2012年4月起任投资副总监。

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、《华宝兴业行业精选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

2012年4季度上半段市场延续疲弱,并创出1949的新低。12月在数据改善和信心恢复的双重刺激下,市场强势反弹。国内方面,在适度宽松货币环境和政府保增长政策的双重作用下,宏观经济出现企稳迹象,房地产和汽车销售以及PMI等数据均有所改善。同时十八大后新上任领导人的表态及行为也加强了市场信心。海外方面,美国财政悬崖的担忧及其后来的阶段性解决,海外指数多数先抑后扬。

4季度前半段,市场依旧担忧企业盈利增速的下滑,强势板块和成长股有所回调。12月,在宏观经济数据向好及流动性偏松的大环境下,低估值和早周期的行业,例如金融地产汽车家电等表现较好,金融地产成为市场上涨的龙头。

4季度我们对市场持相对谨慎的态度,在控制仓位的前提下精挑个股。操作上,一方面继续在优质成长股的回调过程中着眼明年进行配置,同时减持了部分有所反弹但前景不明的个股,另一方面加大了周期类个股的波段操作力度,以获取更多超额收益。但由于仓位较低,虽然在4季度前期表现较好,但12月出现落后。

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4.07%,业绩比较基准收益率为10.02%,基金表现落后业绩比较基准5.95%。

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2013年1季度,国内宏观经济有望延续复苏的趋势,其经济复苏的力度及各行业的弹性需要到3-4月的旺季才能验证。市场在2012年底的大幅反弹已经部分反映了对后期经济企稳复苏的预期,特别是金融和周期性板块,需要基本面的进一步确认。整体上,估值仍偏低的板块以及后续季度确定性较高的行业仍会有所表现,市场会体现出板块轮动的特性。

因此我们将采取相对均衡的投资策略。在保持中性仓位的前提下,继续精选质地优良、估值合理、后期增长确定的优质成长股,积极把握其业绩增长和估值切换带来的成长红利。同时,加大对低估值板块的配置比例和周期股的操作力度,以增强组合的收益。

§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	8,613,600,031.83	76.16
	其中:股票	8,613,600,031.83	76.16
2	固定收益投资	624,845,000.00	5.52
	其中:债券	624,845,000.00	5.52
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	296,100,764.15	2.62
	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	1,222,481,859.07	10.81
6	其他资产	552,581,436.56	4.89
7	合计	11,309,609,091.61	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	1,568,752.98	0.01
B	采掘业	271,910,165.25	2.41
C	制造业	4,004,297,147.54	35.54
C0	食品、饮料	1,057,728,283.14	9.39
C1	纺织、服装、皮毛	58,064,787.19	0.52
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	543,879,233.77	4.83
C5	电子	1,090,480,675.90	9.68
C6	金属、非金属	27,947,402.64	0.25
C7	机械、设备、仪表	322,398,070.15	2.86
C8	医药、生物制品	903,682,191.00	8.02
C99	其他制造业	116,503.75	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	7,009,401.77	0.06
E	建筑业	1,597,083,757.38	14.17
F	交通运输、仓储业	8,034,289.24	0.07
G	信息技术业	260,349,789.87	2.31
H	批发和零售贸易	98,157,078.07	0.87
I	金融、保险业	97,939,722.51	0.87
J	房地产业	1,080,471,760.78	9.59
K	社会服务业	863,427,522.41	7.66
L	传播与文化产业	318,689,765.36	2.83
M	综合类	4,660,878.67	0.04
	合计	8,613,600,031.83	76.45

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	002081	金螳螂	15,649,485	688,890,329.70	6.11
2	002375	亚厦股份	21,879,266	579,362,963.68	5.14
3	300070	碧水源	13,981,976	560,677,237.60	4.98
4	002304	洋河股份	5,843,230	545,582,385.10	4.84
5	002450	康得新	16,199,965	393,659,149.50	3.49
6	600048	保利地产	24,254,910	329,866,776.00	2.93
7	002241	歌尔声学	8,644,363	325,892,485.10	2.89
8	002310	东方园林	5,106,866	320,149,429.54	2.84
9	000002	万 科A	30,600,527	309,677,333.24	2.75
10	600518	康美药业	22,067,567	289,967,830.38	2.57

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	公允价值(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	550,220,000.00	4.88
	其中:政策性金融债	550,220,000.00	4.88
4	企业债券	74,625,000.00	0.66
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	624,845,000.00	5.55

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120218	12国开18	5,500,000	550,220,000.00	4.88
2	112097	12亚厦债	750,000	74,625,000.00	0.66
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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 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 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,597,121.08
2	应收证券清算款	501,786,489.74
3	应收股利	-
4	应收利息	15,018,020.21
5	应收申购款	30,179,805.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	552,581,436.56

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	000002	万 科A	309,677,333.24	2.75	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	12,543,734,363.72
本报告期基金总申购份额	448,329,075.16
减:本报告期基金总赎回份额	288,390,429.38
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	12,703,673,009.50

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;
华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金合同;
华宝兴业行业精选股票型证券投资基金招募说明书;
华宝兴业行业精选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办公场所各投资者查阅。

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
2013年1月21日

华宝兴业增强收益债券型证券投资基金

【2012】第四季度报告

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1月16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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业增强收益债券	
基金主代码	240012	
交易代码	240012	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年2月17日	
报告期末基金份额总额	58,832,622.39份	
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下,追求较高的当期收益和总回报,争取实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金采取积极的资产配置策略,通过宏观策略研究,对相关资产类别(包括固定收益类资产、权益类资产和货币资产等)的预期收益进行动态跟踪,决定其配置比例。	
业绩比较基准	中国债券总指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金和股票型基金,高于货币市场基金。在债券型基金产品中,其长期平均风险程度和预期收益率高于纯债券基金。	
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	华宝兴业增强收益债券A	华宝兴业增强收益债券B
下属两级基金的交易代码	240012	240013
报告期末下属两级基金的份额总额	29,958,410.89份	28,874,211.50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10月1日 - 2012年12月31日)	
	华宝兴业增强收益债券A	华宝兴业增强收益债券B
1.本期已实现收益	236,352.40	193,497.36
2.本期利润	600,792.01	534,852.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.0188	0.0171
4.期末基金资产净值	32,089,697.23	30,449,488.51
5.期末基金份额净值	1.0711	1.0546

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

华宝兴业增强收益债券A

| 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