

华宝兴业可转债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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

2 基金产品概况

5.1 报告期末基金资产组合情况

2012年四季度,持仓市场随大盘上涨而上涨。银行转债,因为正股表现较强,股性较强的转债上涨较多,偏债转债上涨较少。

本基金在2012年四季度初仓位较高,主要集中在偏股型转债,整个操作的节奏较好地对应了市场的节奏。

4.2 报告期内基金的业绩表现

截止至本报告期末,本基金报告内基金份额净值增长率为4.64%,同期业绩比较基准收益率为3.29%,基金基准收益率为基准1.35%。

4.5 个人客户对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

因为转债的到期收益仍处在历史平均略高水位,转债向下的债券价值支撑比较扎实;因此,转债仍将是配置价值2013年,季度,资金流动性将有所改善,积极财政政策是主基调,海外市场会进一步审美美,配置将逐步采取指数化和蓝筹股信心等,因此,股市向上的支持因素也是较多的,触发的一些小转债将更多受益。转债将被分化。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

基金简称	华宝兴业可转债债券型证券投资基金	报告期	2012年10月1日-2012年12月31日
基金主代码	240018	净值	-
交易代码	240018	份额	-
基金运作方式	契约型开放式	资产	-
基金合同生效日	2011年4月27日	负债	-
报告期末基金份额总额	714,094,407.12份	负债	-
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司	负债	-
基金托管人	招商银行股份有限公司	负债	-

5.2 基金产品概况

5.3 报告期末基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	-	-
2	其中:股票	-	-
3	固定收益投资	806,570,365.17	96.35
4	其中:债券	806,570,365.17	96.35
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	6,095,341.00	0.73
10	其他资产	24,489,758.61	2.93
11	合计	837,155,464.78	100.00

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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五名资产支持证券投资明细

5.7 报告期末持有的各类型基金的名称和份额

5.8 基金管理人发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内部监管立案调查,也未有书面报告日前一日内受到公开谴责、处罚,无证券投资决策程序特别说明。

5.9 本基金报告期末未持有股票投资。

5.8 其他资产/负债

5.9 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.12 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.13 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.16 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.17 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.18 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.19 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.20 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.21 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.22 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.23 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.24 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.25 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.26 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.27 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.28 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.29 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.30 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.31 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.32 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.33 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.34 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.35 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.36 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.37 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.38 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.39 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.40 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.41 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.42 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.43 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.44 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.45 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.46 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.47 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.48 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.49 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.50 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.51 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.52 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.53 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.54 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.55 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.56 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.57 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.58 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.59 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.60 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.61 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.62 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.63 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.64 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.65 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.66 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.67 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.68 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.69 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.70 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.71 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.72 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.73 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.74 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.75 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.76 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.77 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.78 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.79 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.80 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.81 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.82 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.83 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.84 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.85 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.86 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.87 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.88 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.89 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.90 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.91 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.92 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.93 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.94 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.95 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.96 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.97 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.98 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.99 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.12 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.13 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细