

2013年1月21日 星期一

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。

本报告中财务数据未经审计。  
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 华宝兴业宝康配置混合  
基金代码 240002  
交易代码 240002  
基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2003年7月15日  
报告期末基金份额总额 618,126,842.86份

投资目标 避免本金损失，降低资产组合波动性，提高投资组合的长期回报。

投资策略 在严格控制风险的前提下，以债券投资为基础，积极配置股票，同时执行严格的投资制度和风险管理机制。

业绩比较基准 65%×中信标普全债指数+35%×上证180指数和深证100指数的复合指数

业绩比较基准 65%×中信标普全债指数+35%×上证180流通市值+深证100流通市值

基金管理人员 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**

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 -8,316,996.33

2.本期利润 56,439,454.29

3.加权平均基金份额本期利润 0.0900

4.期末基金资产净值 796,068,365.15

5.期末基金份额净值 1.2879

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据。

3.2 基金净值表现

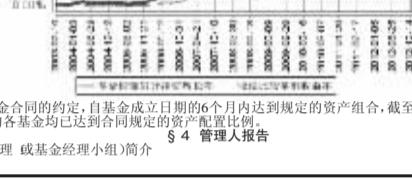
3.2.1 报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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 收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 7.67% 0.94% 4.62% 0.46% 3.05% 0.48%

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

2003年7月15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2004年1月15日,本基金下设的各基金均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

4.2 公平交易行为的专项说明

4.3 公平交易制度的执行情况

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾2012四季度,中国经济经历了近一年半多的增速下降之后,开始出现明显的探底企稳迹象;同时,十八大召开和召开,以及新一届领导层所表现出的务实作风和改革决心,使得投资者显著增强了对中国经济长期前景的信心,国际方面,美国经济持续复苏,欧洲危机暂时有所缓解,海外市场持续上涨,国内经济复苏和国家基础设施的投资拉动,出现了明显的环比改善。四季度A股先跌后涨,触底后出现强劲反弹11月底上证指数一度跌破1950点,但12月底即迅速收复到了2500点。四季度期间,上证综指和沪深300指数分别上涨7.7%和10.02%,中小板指数下跌6.6%,创业板指数上涨3.51%。总体而言,大盘股和周期股表现优于小盘股及消费类股。分行业来看,各行业板块指数表现差异很大,其中房地产、交通运输、建筑建材、金融保险、家用电器等行业的涨幅都在20%以上,而食品饮料、餐饮旅游、信息服务、信息设备、有色金属等行业的涨幅相对靠后。

我们认为第四季度将延续低估值,维持高仓位的策略,同时,持有的小市值股票表现较好,基金整体四季度表现处于同类基金之上。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止至本报告期末,本基金单位净值为1.2879元,本报告期内基金份额净值增长率为7.67%,业绩比较基准收益率为4.62%,基金表现超越业绩比较基准3.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

展望2013年一季度,中国经济有望继续企稳小幅回升,流动性也将继续恢复,而随着通胀水平稳定并略有上升,企业盈利也将触底回升。

一季度两会召开以及政府换届结束后,政策方向将逐步确定,投资者对经济形势的预期也将更加明朗。我们认为,一季度末市场的强势反弹已经对经济企稳和市场信心的修复做出较好的信号,因此,我们将继续把握市场的反弹机会,阶段性地把仓位调回平衡点的机会。

同时,我们将继续坚持稳健的选股策略,总体保持较高仓位的股票仓位,尽可能合理的系统性投资和操作,继续保持重仓和持股的稳定性,为基金份额持有人创造更多的投资回报。

最后,感谢持有人一直以来对我们的支持,在以后的投资中,我们将继续努力,努力为持有人创造更好的回报。

4.5 投资组合报告

4.6 备查文件目录

4.7 备查文件

4.8 其他

# 华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金

## 2012 第 四 季 度 报 告

报告期:2012年10月1日至2012年12月31日

截止日期:2013年1月21日

公告日期:2013年1月21日

披露日期:2013年1月21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: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。

本报告中财务数据未经审计。

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 华宝兴业宝康配置混合  
基金代码 240002  
交易代码 240002  
基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2003年7月15日  
报告期末基金份额总额 618,126,842.86份

投资目标 避免本金损失，降低资产组合波动性，提高投资组合的长期回报。

投资策略 在严格控制风险的前提下，以债券投资为基础，积极配置股票，同时执行严格的投资制度和风险管理机制。

业绩比较基准 65%×中信标普全债指数+35%×上证180指数和深证100指数的复合指数

业绩比较基准 65%×中信标普全债指数+35%×上证180流通市值+深证100流通市值

基金管理人员 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**

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 -73,928,744.83

2.本期利润 58,599,293.09

3.加权平均基金份额本期利润 0.0933

4.期末基金资产净值 2,108,002,439.78

5.期末基金份额净值 1.2757

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据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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 收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 2.67% 0.78% 9.24% 1.04% -6.57% -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

2003年7月15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2004年1月15日,本基金下设的各基金均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

4.2 公平交易行为的专项说明

4.3 公平交易制度的执行情况

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

回顾2012四季度,中国经济经历了近一年半多的增速下降之后,开始出现明显的探底企稳迹象;同时,十八大召开和召开,以及新一届领导层所表现出的务实作风和改革决心,使得投资者显著增强了对中国经济长期前景的信心,国际方面,美国经济持续复苏,欧洲危机暂时有所缓解,海外市场持续上涨,国内经济复苏和国家基础设施的投资拉动,出现了明显的环比改善。四季度A股先跌后涨,触底后出现强劲反弹11月底上证指数一度跌破1950点,但12月底即迅速收复到了2500点。四季度期间,上证综指和沪深300指数分别上涨7.7%和10.02%,中小板指数下跌6.6%,创业板指数上涨3.51%。总体而言,大盘股和周期股表现优于小盘股及消费类股。分行业来看,各行业板块指数表现差异很大,其中房地产、交通运输、建筑建材、金融保险、家用电器等行业的涨幅都在20%以上,而食品饮料、餐饮旅游、信息服务、信息设备、有色金属等行业的涨幅相对靠后。

我们认为第四季度将延续低估值,维持高仓位的策略,同时,持有的小市值股票表现较好,基金整体四季度表现处于同类基金之上。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止至本报告期末,本基金单位净值为1.2757元,本报告期内基金份额净值增长率为2.67%,业绩比较基准收益率为9.24%,基金表现超越业绩比较基准-6.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

展望2013年一季度,中国经济有望继续企稳小幅回升,流动性也将继续恢复,而随着通胀水平稳定并略有上升,企业盈利也将触底回升。

一季度两会召开以及政府换届结束后,政策方向将逐步确定,投资者对经济形势的预期也将更加明朗。我们认为,一季度末市场的强势反弹已经对经济企稳和市场信心的修复做出较好的信号,因此,我们将继续把握市场的反弹机会,阶段性地把仓位调回平衡点的机会。

同时,我们将继续坚持稳健的选股策略,总体保持较高仓位的股票仓位,尽可能合理的系统性投资和操作,继续保持重仓和持股的稳定性,为基金份额持有人创造更多的投资回报。

感谢持有人一直以来对我们的支持,在以后的投资中,我们将继续总结经验,勤勉尽责,努力实现消费基金的良好表现。

4.5 投资组合报告

4.6 备查文件目录

4.7 备查文件

4.8 其他

# 华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金

## 2012 第 四 季 度 报 告

报告期:2012年10月1日至2012年12月31日

截止日期:2013年1月21日

公告日期:2013年1月21日

披露日期:2013年1月21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: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。

本报告中财务数据未经审计。

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 华宝兴业宝康配置混合  
基金代码 240002  
交易代码 240002  
基金运作方式 约定开放式