

## 华宝兴业可转债债券型证券投资基金

## [2015] 第二季度报告

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司  
基金托管人:招商银行股份有限公司  
报告日期:2015年6月18日  
§ 1 重要提示  
基金管理人的董事、监事及高级管理人员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。  
基金托管人根据法律法规的有关规定，于2015年6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。  
本报告期无财务会计报告。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

## § 2 基本产品概况

基金简称	华宝兴业可转债债券型证券投资基金
基金主代码	240016
交易代码	240018
基金运作方式	契约型开放式
基金份额总额	2011年4月27日 117,145,496.49份
报告期末基金份额总额	2015年6月30日 2,545,117.68份 1.37%
投资目标	在控制风险的前提下保持资产流动性的前提下，主要通过对可转债的投资，力争在基准收益的基础上获得超越基准的收益。
投资策略	本基金采用自上而下的宏观投资策略，通过对中国宏观经济环境、政策环境、资金面、利率水平、信用利差、信用等级、流动性、估值水平、行业景气度、市场情绪等多方面的综合分析，在把握收益率、风险收益和相关法律法规的指导下，选择信用等级较高且具有较好流动性的可转债进行投资，重点关注信用评级在AA以上且期限在一年以上的可转债。
业绩比较基准	中证转债指数收益率×70%+国债收益率×30%。
风险收益特征	本基金为债券基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金，但低于股票型基金。
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标

(单位:人民币元)

主要财务指标 报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)

1.本期利息收入 113,747,323.03

2.期间费用 3,432,363.26

3.加权平均基金份额本期利润 0.01178

4.期末基金份额净值 183,226,956.83

5.期末基金资产净值 1,5812

注:1.本期利息收入指基金本期利息收入,减去应付利息后的余额,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,即为本期利润;2.本期基金份额净值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。

2.所列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.基金净值表现表不包括持有人认购或交易基金的各项费用,费用影响会导致基金份额净值的变化。

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间 证券从业年限

王瑞海 固定收益部总经理,本基金基金经理 2014年5月16日 - 20年

说明:瑞士,曾在深圳大鹏投资管理有限公司担任基金经理,并入华宝兴业基金管理有限公司,太平资产管理有限公司,从事固定收益类产品的投资研究工作,2012年7月加入华宝兴业基金管理有限公司,任基金经理。2013年1月至2014年1月任华宝兴业基金管理有限公司债券投资部总监,2014年2月至2014年5月任华宝兴业基金管理有限公司固收部总监,2014年5月起兼任华宝兴业固定收益部总监,2015年5月起兼任华宝兴业基金管理有限公司固收部总监,2015年6月起兼任华宝兴业基金管理有限公司固收部总监。

注:1.任本基金基金经理时间从首次任职之日起计算。  
2.本基金基金经理从行业从业经历由基金管理人和基金托管人共同确认。

4.2 管理费率

本基金的管理费率为每年0.60%,管理费每日按比例计提,并按月支付。

4.3 托管费率

本基金的托管费率为每年0.15%,托管费每日按比例计提,并按月支付。

4.4 报告期内基金管理人报酬披露情况及说明

4.4.1 报告期内基金管理人报酬披露运作情况

同一季度,一季度度一直面临着转换被赎回的压力,转换市场的规模在迅速压缩,与此同时,转换市场走出先抑后扬的行情,六月份的下跌,五月份的上涨,从震荡的来看,转换市场的赎回率都呈现出明显的波动,新兴市场对资金的状况也出现了明显的波动,因此,在赎回压力的推动下,转换市场的赎回率被抑制,对冲了很大的风险,由于强制赎回的回吐,持有的债券有所下降,大大限制了投资的空间,被迫进行集中投资,不利于分散风险。随着转换压力的逐步增多,这种情况将有逆转。

4.4.2 报告期内基金管理人报酬披露说明

本报告期内,基金管理人报酬披露情况与去年同期相比没有变化。

4.4.3 公司内部交易情况说明

本报告期内,基金管理人通过严格执行投资决策委员会会议规则,公司股票库管理制度,中央交易室制度,防火墙机制,系统的公平交易规则,每时每刻的监督,确保所管理的所投资产合规,从投资决策、投资研究、风险管理、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估到投资合规和道德行为规范,基金管理人严守法律法规关于公平交易的规定,严格遵守投资决策委员会会议规则,充分尊重基金经理的独立性,并根据基金经理的个人利益,分门别类地给予不同的待遇,不涉及利益输送。为本报告期内,基金管理人严守法律法规关于公平交易的规定。

4.4.4 报告期内基金管理人报酬披露情况及说明

4.4.5 报告期内基金管理人报酬披露运作情况

同一季度,一季度度一直面临着转换被赎回的压力,转换市场的规模在迅速压缩,与此同时,转换市场走出先抑后扬的行情,六月份的下跌,五月份的上涨,从震荡的来看,转换市场的赎回率都呈现出明显的波动,新兴市场对资金的状况也出现了明显的波动,因此,在赎回压力的推动下,转换市场的赎回率被抑制,对冲了很大的风险,由于强制赎回的回吐,持有的债券有所下降,大大限制了投资的空间,被迫进行集中投资,不利于分散风险。随着转换压力的逐步增多,这种情况将有逆转。

4.4.6 报告期内基金管理人报酬披露说明

本报告期内,基金管理人报酬披露情况与去年同期相比没有变化。

4.4.7 报告期内基金管理人报酬披露情况及说明

本报告期内,基金管理人报酬披露情况与去年同期相比没有变化。

4.4.8 报告期内基金管理人报酬披露运作情况

同一季度,一季度度一直面临着转换被赎回的压力,转换市场的规模在迅速压缩,与此同时,转换市场走出先抑后扬的行情,六月份的下跌,五月份的上涨,从震荡的来看,转换市场的赎回率都呈现出明显的波动,新兴市场对资金的状况也出现了明显的波动,因此,在赎回压力的推动下,转换市场的赎回率被抑制,对冲了很大的风险,由于强制赎回的回吐,持有的债券有所下降,大大限制了投资的空间,被迫进行集中投资,不利于分散风险。随着转换压力的逐步增多,这种情况将有逆转。

4.4.9 报告期内基金管理人报酬披露说明

本报告期内,基金管理人报酬披露情况与去年同期相比没有变化。

4.4.10 报告期内基金管理人报酬披露情况及说明

本报告期内,基金管理人报酬披露情况与去年同期相比没有变化。

4.4.11 报告期内基金管理人报酬披露运作情况

同一季度,一季度度一直面临着转换被赎回的压力,转换市场的规模在迅速压缩,与此同时,转换市场走出先抑后扬的行情,六月份的下跌,五月份的上涨,从震荡的来看,转换市场的赎回率都呈现出明显的波动,新兴市场对资金的状况也出现了明显的波动,因此,在赎回压力的推动下,转换市场的赎回率被抑制,对冲了很大的风险,由于强制赎回的回吐,持有的债券有所下降,大大限制了投资的空间,被迫进行集中投资,不利于分散风险。随着转换压力的逐步增多,这种情况将有逆转。

4.4.12 报告期内基金管理人报酬披露说明

本报告期内,基金管理人报酬披露情况与去年同期相比没有变化。

4.4.13 报告期内基金管理人报酬披露情况及说明

本报告期内,基金管理人报酬披露情况与去年同期相比没有变化。

4.4.14 报告期内基金管理人报酬披露运作情况

同一季度,一季度度一直面临着转换被赎回的压力,转换市场的规模在迅速压缩,与此同时,转换市场走出先抑后扬的行情,六月份的下跌,五月份的上涨,从震荡的来看,转换市场的赎回率都呈现出明显的波动,新兴市场对资金的状况也出现了明显的波动,因此,在赎回压力的推动下,转换市场的赎回率被抑制,对冲了很大的风险,由于强制赎回的回吐,持有的债券有所下降,大大限制了投资的空间,被迫进行集中投资,不利于分散风险。随着转换压力的逐步增多,这种情况将有逆转。

4.4.15 报告期内基金管理人报酬披露说明

本报告期内,基金管理人报酬披露情况与去年同期相比没有变化。

4.4.16 报告期内基金管理人报酬披露情况及说明

本报告期内,基金管理人报酬披露情况与去年同期相比没有变化。

4.4.17 报告期内基金管理人报酬披露运作情况

同一季度,一季度度一直面临着转换被赎回的压力,转换市场的规模在迅速压缩,与此同时,转换市场走出先抑后扬的行情,六月份的下跌,五月份的上涨,从震荡的来看,转换市场的赎回率都呈现出明显的波动,新兴市场对资金的状况也出现了明显的波动,因此,在赎回压力的推动下,转换市场的赎回率被抑制,对冲了很大的风险,由于强制赎回的回吐,持有的债券有所下降,大大限制了投资的空间,被迫进行集中投资,不利于分散风险。随着转换压力的逐步增多,这种情况将有逆转。

4.4.18 报告期内基金管理人报酬披露说明

本报告期内,基金管理人报酬披露情况与去年同期相比没有变化。

4.4.19 报告期内基金管理人报酬披露情况及说明

本报告期内,基金管理人报酬披露情况与去年同期相比没有变化。

4.4.20 报告期内基金管理人报酬披露运作情况

同一季度,一季度度一直面临着转换被赎回的压力,转换市场的规模在迅速压缩,与此同时,转换市场走出先抑后扬的行情,六月份的下跌,五月份的上涨,从震荡的来看,转换市场的赎回率都呈现出明显的波动,新兴市场对资金的状况也出现了明显的波动,因此,在赎回压力的推动下,转换市场的赎回率被抑制,对冲了很大的风险,由于强制赎回的回吐,持有的债券有所下降,大大限制了投资的空间,被迫进行集中投资,不利于分散风险。随着转换压力的逐步增多,这种情况将有逆转。

4.4.21 报告期内基金管理人报酬披露说明

本报告期内,基金管理人报酬披露情况与去年同期相比没有变化。

4.4.22 报告期内基金管理人报酬披露情况及说明

本报告期内,基金管理人报酬披露情况与去年同期相比没有变化。

4.4.23 报告期内基金管理人报酬披露运作情况

同一季度,一季度度一直面临着转换被赎回的压力,转换市场的规模在迅速压缩,与此同时,转换市场走出先抑后扬的行情,六月份的下跌,五月份的上涨,从震荡的来看,转换市场的赎回率都呈现出明显的波动,新兴市场对资金的状况也出现了明显的波动,因此,在赎回压力的推动下,转换市场的赎回率被抑制,对冲了很大的风险,由于强制赎回的回吐,持有的债券有所下降,大大限制了投资的空间,被迫进行集中投资,不利于分散风险。随着转换压力的逐步增多,这种情况将有逆转。

4.4.24 报告期内基金管理人报酬披露说明

本报告期内,基金管理人报酬披露情况与去年同期相比没有变化。

4.4.25 报告期内基金管理人报酬披露情况及说明

本报告期内,基金管理人报酬披露情况与去年同期相比没有变化。

4.4.26 报告期内基金管理人报酬披露运作情况

同一季度,一季度度一直面临着转换被赎回的压力,转换市场的规模在迅速压缩,与此同时,转换市场走出先抑后扬的行情,六月份的下跌,五月份的上涨,从震荡的来看,转换市场的赎回率都呈现出明显的波动,新兴市场对资金的状况也出现了明显的波动,因此,在赎回压力的推动下,转换市场的赎回率被抑制,对冲了很大的风险,由于强制赎回的回吐,持有的债券有所下降,大大限制了投资的空间,被迫进行集中投资,不利于分散风险。随着转换压力的逐步增多,这种情况将有逆转。

4.4.27 报告期内基金管理人报酬披露说明

本报告期内,基金管理人报酬披露情况与去年同期相比没有变化。

4.4.28 报告期内基金管理人报酬披露情况及说明

本报告期内,基金管理人报酬披露情况与去年同期相比没有变化。

4.4.29 报告期内基金管理人报酬披露运作情况

同一季度,一季度度一直面临着转换被赎回的压力,转换市场的规模在迅速压缩,与此同时,转换市场走出先抑后扬的行情,六月份的下跌,五月份的上涨,从震荡的来看,转换市场的赎回率都呈现出明显的波动,新兴市场对资金的状况也出现了明显的波动,因此,在赎回压力的推动下,转换市场的赎回率被抑制,对冲了很大的风险,由于强制赎回的回吐,持有的债券有所下降,大大限制了投资的空间,被迫进行集中投资,不利于分散风险。随着转换压力的逐步增多,这种情况将有逆转。

4.4.30 报告期内基金管理人报酬披露说明

本报告期内,基金管理人报酬披露情况与去年同期相比没有变化。

4.4.31 报告期内基金管理人报酬披露情况及说明

本报告期内,基金管理人报酬披露情况与去年同期相比没有变化。

4.4.32 报告期内基金管理人报酬披露运作情况

同一季度,一季度度一直面临着转换被赎回的压力,转换市场的规模在迅速压缩,与此同时,转换市场走出先抑后扬的行情,六月份的下跌,五月份的上涨,从震荡的来看,转换市场的赎回率都呈现出明显的波动,新兴市场对资金的状况也出现了明显的波动,因此,在赎回压力的推动下,转换市场的赎回率被抑制,对冲了很大的风险,由于强制赎回的回吐,持有的债券有所下降,大大限制了投资的空间,被迫进行集中投资,不利于分散风险。随着转换压力的逐步增多,这种情况将有逆转。

4.4.33 报告期内基金管理人报酬披露说明

本报告期内,基金管理人报酬披露情况与去年同期相比没有变化。

4.4.34 报告期内基金管理人报酬披露情况及说明

本报告期内,基金管理人报酬披露情况与去年同期相比没有变化。

4.4.35 报告期内基金管理人报酬披露运作情况

同一季度,一季度度一直面临着转换被赎回的压力,转换市场的规模在迅速压缩,与此同时,转换市场走出先抑后扬的行情,六月份的下跌,五月份的上涨,从震荡的来看,转换市场的赎回率都呈现出明显的波动,新兴市场对资金的状况也出现了明显的波动,因此,在赎回压力的推动下,转换市场的赎回率被抑制,对冲了很大的风险,由于强制赎回的回吐,持有的债券有所下降,大大限制了投资的空间,被迫进行集中投资,不利于分散风险。随着转换压力的逐步增多,这种情况将有逆转。

4.4.36 报告期内基金管理人报酬披露说明

本报告期内,基金管理人报酬披露情况与去年同期相比没有变化。

4.4.37 报告期内基金管理人报酬披露情况及说明

本报告期内,基金管理人报酬披露情况与去年同期相比没有变化。

4.4.38 报告期内基金管理人报酬披露运作情况

同一季度,一季度度一直面临着转换被赎回的压力,转换市场的规模在迅速压缩,与此同时,转换市场走出先抑后扬的行情,六月份的下跌,五月份的上涨,从震荡的来看,转换市场的赎回率都呈现出明显的波动,新兴市场对资金的状况也出现了明显的波动,因此,在赎回压力的推动下,转换市场的赎回率被抑制,对冲了很大的风险,由于强制赎回的回吐,持有的债券有所下降,大大限制了投资的空间,被迫进行集中投资,不利于分散风险。随着转换压力的逐步增多,这种情况将有逆转。

4.4.39 报告期内基金管理人报酬披露说明

本报告期内,基金管理人报酬披露情况与去年同期相比没有变化。

4.4.40 报告期内基金管理人报酬披露情况及说明

本报告期内,基金管理人报酬披露情况与去年同期