

华宝兴业增强收益债券型证券投资基金 2013 年第 3 季度报告

2013 年 9 月 30 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

报告送出日期：2013 年 10 月 24 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 10 月 22 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 2013 年 7 月 1 日起至 9 月 30 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	48,970,356.12 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	25,195,956.26 份	23,774,399.86 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（2013年7月1日—2013年9月30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	631,512.63	532,689.65
2. 本期利润	921,407.28	786,017.41
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0373	0.0358
4. 期末基金资产净值	28,387,712.46	26,291,497.39
5. 期末基金份额净值	1.1267	1.1059

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	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.48%	0.31%	-2.68%	0.09%	6.16%	0.22%

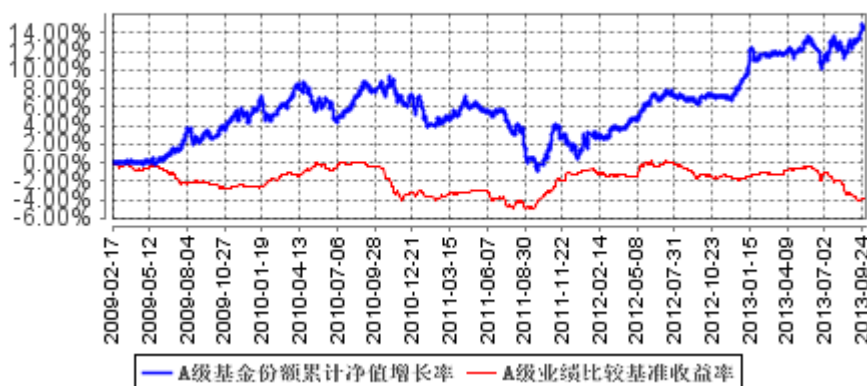
华宝兴业增强收益债券 B

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	3.37%	0.31%	-2.68%	0.09%	6.05%	0.22%

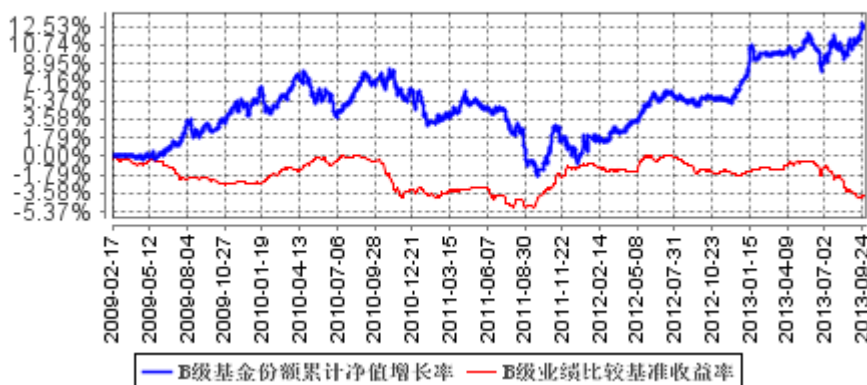
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

（2009年2月17日至2013年9月30日）

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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 2009 年 8 月 16 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		
王瑞海	固定收益部总经理、本基金基金经理	2013 年 4 月 8 日	-	18 年	硕士。曾在深圳中大投资管理公司、海南证券北京营业部、太平人寿保险有限公司、太平资产管理有限公司从事投资管理、股票自营和固定收益投资研究工作。2012 年 7 月加入华宝兴业基金管理有限公司，任固定收益部总经理。2013 年 4 月起兼任华宝兴业增强收益债

					券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、《华宝兴业增强收益债券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

三季度，在经历了六月底的“钱荒”后，市场对货币政策短期走向的担忧逐渐弱化，但市场对未来利率的走势给出了判断，债券市场呈现收益率的整体上行，特别是中长期利率品种收益率上升的幅度比较大。股票市场七、八月份以创业板、中小板为代表的小市值股票表现良好，八月下旬开始的自贸区概念股票表现强劲。债券投资继续延袭降久期、降杠杆、提信用的策略，股票投资坚持以创业板、中小板为主，并适当参与了自贸区概念股票的投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期内增强收益 A 基金份额净值增长率为 3.48%，同期业绩比较基准收益率为-2.68%；增强收益 B 基金份额净值增长率为 3.37%，同期业绩比较基准收益率为-2.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013 年最后一个季度，最大的变数就是将要召开的“三中全会”，对会议的各种预期，会对市场的运行产生较大的影响。根据最高层在各个场合的讲话，可以确定的是，经济会保底，调结构会继续进行下去，科技进步的作用将得到加强，最重要的一点是未来改革的力度会很大。基于这些认识，宏观经济不会有大的起伏，证券市场对各种改革措施可能会反应过度，新股发行等等因素可能会使市场波动加大。固定收益的收益率继续走高的概率较大，利差加大的可能性加大。国债预发行及国债期货的市场效应要加强观察，随着这两个市场交易的活跃，与国债相关的新产品推出会增多，国债市场会出现各种新变化。

§ 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	6,088,622.00	10.59
	其中：股票	6,088,622.00	10.59
2	固定收益投资	41,960,195.80	72.98
	其中：债券	41,960,195.80	72.98
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	3,800,000.00	6.61
	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	557,728.32	0.97
6	其他资产	5,089,749.28	8.85
7	合计	57,496,295.40	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	采矿业	-	-
C	制造业	1,418,900.00	2.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	975,590.00	1.78
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,307,592.00	2.39
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,244,880.00	2.28
L	租赁和商务服务业	1,141,660.00	2.09
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,088,622.00	11.14

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	300315	掌趣科技	46,800	1,307,592.00	2.39
2	600663	陆家嘴	52,000	1,244,880.00	2.28
3	002400	省广股份	26,000	1,141,660.00	2.09
4	002292	奥飞动漫	30,000	1,102,200.00	2.02
5	600284	浦东建设	77,000	975,590.00	1.78
6	300205	天喻信息	10,000	316,700.00	0.58

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	4,987,500.00	9.12
	其中：政策性金融债	4,987,500.00	9.12
4	企业债券	36,970,518.60	67.61
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,177.20	0.00
8	其他	-	-
9	合计	41,960,195.80	76.74

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	130201	13 国开 01	50,000	4,987,500.00	9.12
2	112015	09 泛海债	43,500	4,406,550.00	8.06
3	126015	08 康美债	41,000	3,988,890.00	7.30
4	122974	09 镇城投	30,250	3,034,075.00	5.55
5	122045	10 中铁 G1	29,000	2,900,000.00	5.30

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.8.1 本期国债期货投资政策**

本基金未投资国债期货。

5.8.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

5.8.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.9 投资组合报告附注**5.9.1**

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。

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	33,648.66
2	应收证券清算款	487,955.28
3	应收股利	-
4	应收利息	1,046,900.98
5	应收申购款	3,521,244.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,089,749.28

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	110018	国电转债	2,177.20	0.00

5.9.5 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	002292	奥飞动漫	1,102,200.00	2.02	重大资产重组
2	002400	省广股份	1,141,660.00	2.09	重大资产重组
3	002315	掌趣科技	1,307,592.00	2.39	重大资产重组

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝兴业增强收益债券 A	华宝兴业增强收益债券 B
报告期期初基金份额总额	25,007,405.51	22,644,224.19
报告期期间基金总申购份额	4,610,594.91	6,732,476.88
减:报告期期间基金总赎回份额	4,422,044.16	5,602,301.21
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	25,195,956.26	23,774,399.86

注:总申购份额含转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用自有资金投资本公司管理基金情况

单位：元

序号	交易方式	交易日期	交易金额	适用费率
1	赎回	2013 年 9 月 30 日	-33,254.83	0.00%
2	申购	2013 年 9 月 30 日	70,000.00	0.00%
合计			36,745.17	

注：赎回的为增强收益债券 A 类，申购的为增强收益债券 B 类，交易日期为确认日期，交易金额为确认金额。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

1、2013 年 8 月 8 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，公司总经理裴长江先生因个人原因，自 2013 年 7 月 31 日起不再担任总经理职务，由黄小蕙女士代任。

2、2013 年 9 月 27 日，基金管理人发布高级管理人员任职公告，黄小蕙女士自 2013 年 9 月 24 日起正式担任公司总经理。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
 华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金合同；
 华宝兴业增强收益债券型证券投资基金招募说明书；
 华宝兴业增强收益债券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。

9.2 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备投资者查阅。

9.3 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 10 月 24 日