

华安可转换债券债券型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012年12月31日

基金管理人：华安基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一三年一月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会对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。

基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，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。投资者投资于基金前应仔细阅读基金的招募说明书。

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

基金简称	华安可转债债券
基金代码	040022
基金运作方式	契约型开放式
报告期末基金份额总额	673,307,219.72份
投资目标	本基金主要投资于具备债券投资特性的可转债品种，在控制风险和保持流动性的基础上，力求实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金主要投资于可转债品种，一方面通过利用可转债的特性，强调资产的稳定性；另一方面通过可转债的特性，将资产配置于股票、债券、货币市场等不同资产类别，分散投资风险，提高资产的稳定性。
业绩比较基准	天相开放式基金指数*80%+沪深300指数*10%+银行存款利率*10%。
风险收益特征	本基金为债券基金，其风险和预期收益低于股票基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中的中等风险和中等收益品种。
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	华安可转债债券A类
下属分级基金的交易代码	040022
报告期末下属分级基金的份额总额	300,605,250.66份
报告期末下属分级基金的份额总额	282,701,969.06份

§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		-2,829,769.05									
2.本期利润		34,171,306.03									
3.期初至报告期期末的累计损益		-0.076									
4.期末基金净值		404,836,428.78									
5.期末基金份额净值		1.028									
6.报告期未按行业分类的股票投资组合											
7.合计											

§4 财务指标

阶段	净值增长率①	净值增长标准差②	业绩比较基准收益差③	业绩比较基准收益和基准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.37%	0.59%	3.80%	0.31%	4.57%	0.28%
2.华安可转债债券A类：						
阶段	净值增长率①	净值增长标准差②	业绩比较基准收益差③	业绩比较基准收益和基准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.41%	0.60%	3.80%	0.31%	4.61%	0.29%

§5.2 报告期未按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	占基金资产净值比例 (%)
A 农、林、牧、渔业	-	-
B 制造业	-	-
C 食品、饮料	-	-
C1 纺织、服装、皮革、毛皮	-	-
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、仪表	-	-
C8 医药、生物制品	-	-
C99 其他制造业	-	-
D 电力、煤气及水的生产和供应业	15,904,500.02	2.28
E 建筑业	-	-
F 交通运输、仓储业	-	-
G 信息技术业	-	-
H 批发、零售贸易	-	-
I 金融、保险业	-	-
J 房地产业	39,694,238.61	5.70
K 社会服务业	-	-
L 文化、体育产业	-	-
M 综合类	-	-
合计	55,598,742.63	7.99

§5.3 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		-2,829,769.05									
2.本期利润		34,171,306.03									
3.期初至报告期期末的累计损益		-0.076									
4.期末基金净值		404,836,428.78									
5.期末基金份额净值		1.028									
6.报告期未按行业分类的股票投资组合											
7.合计											

§5.4 财务指标

阶段	净值增长率①	净值增长标准差②	业绩比较基准收益差③	业绩比较基准收益和基准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.37%	0.59%	3.80%	0.31%	4.57%	0.28%
2.华安可转债债券A类：						
阶段	净值增长率①	净值增长标准差②	业绩比较基准收益差③	业绩比较基准收益和基准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.41%	0.60%	3.80%	0.31%	4.61%	0.29%

§5.5 报告期未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组合

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	600048	保利地产	1,700,000	23,120,000.00	3.32
2	600208	新钢股份	3,845,531	16,574,238.61	2.38
3	600292	九芝堂	1,264,269	15,904,500.02	2.28
4	102011	石化债	29,402,756.40	42.22	
5	102012	石化债	29,402,756.40	42.22	

§5.6 报告期未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

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	101015	石化债	1,807,110	185,969,690.10	26.71
2	111003	重钢债	1,450,930	151,479,375.40	22.05
3	110200	工行债	859,640	91,058,772.00	13.08
4	101016	工行债	632,940	68,838,554.40	9.89
5	120111	石化债	550,950	53,755,200.00	7.72

§5.7 备查文件目录

本报告期未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						
1.权证代码						

§5.8 备查文件目录

本报告期未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组合			
-----------------------------------	--	--	--