

华宝兴业宝康消费品证券投资基金

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

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。

Table with 2 columns: Item (基金简称, 基金代码, etc.) and Value (宝康消费品, 24001, etc.)

3.1 主要财务指标
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)

Table with 2 columns: Item (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and Value (-73,928,744.83, 85,599,203.09, etc.)

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。

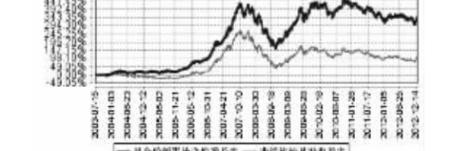
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

Table with 6 columns: Period (阶段), Net Growth Rate (净值增长率), Benchmark (净值增长率标准差), etc.

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,本基金成立初期6个月内达到规定的资产组合,截至2004年1月15日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

4.1 基金经理 魏基金基金经理 简介

Table with 4 columns: Name (姓名), Position (职务), Tenure (任职日期), and Bio (说明)

4.2 管理人对于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投资基金法》及其他相关法律法规,基金合同及基金招募说明书,勤勉尽责,诚实信用,履行了基金管理人应尽的义务,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的利益。

4.3 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人通过严格执行投资决策委员会会议规则,公司投资决策管理制度,中央交易室制度,防火墙机制,系统中的公平交易程序,每日交易日报制度,定期基金投资绩效评估机制,确保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各环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本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%。

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
四季度市场出现大幅反弹,金融板块以及周期板块较大,本基金整体配置于消费品,宽基1股保守,行业上有得失,在消费、汽车和家电等行业上取得收益,但食品饮料、医药等行业配置较深,表现不佳,拖累整体业绩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末,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%,基金后业业绩比较基准6.75%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为短期经济企稳,通胀压力以及周期板块较大,本基金整体配置于消费品,宽基1股保守,行业上有得失,在消费、汽车和家电等行业上取得收益,但食品饮料、医药等行业配置较深,表现不佳,拖累整体业绩。

感谢持有人一直以来对我们的支持,在后续投资中,我们将继续总结经验,勤勉尽责,努力实现消费品基金的良好表现。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: Item (序号), Project (项目), Amount (金额)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: Code (代码), Industry (行业类别), Fair Value (公允价值), Proportion (占基金资产净值比例)

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

Table with 4 columns: Rank (序号), Code (股票代码), Name (股票名称), Amount (数量)

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: Rank (序号), Bond Type (债券品种), Fair Value (公允价值), Proportion (占基金资产净值比例)

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

Table with 4 columns: Rank (序号), Bond Code (债券代码), Bond Name (债券名称), Amount (数量)

5.6 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

5.7 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金管理人未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,不存在投资关联方证券的情形。

5.8.2 本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。

5.8.3 其他资产构成

Table with 2 columns: Item (序号), Name (名称), Amount (金额)

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 4 columns: Rank (序号), Bond Code (债券代码), Bond Name (债券名称), Amount (数量)

5.8.5 报告期末持有的处于转股期可转换债券情况说明

5.8.6 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.7 其他资产构成

Table with 2 columns: Item (序号), Name (名称), Amount (金额)

5.8.8 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.9 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.10 其他资产构成

5.8.11 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.12 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.13 其他资产构成

5.8.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.15 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.16 其他资产构成

5.8.17 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.18 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.19 其他资产构成

5.8.20 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.21 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.22 其他资产构成

5.8.23 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.24 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.25 其他资产构成

5.8.26 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.27 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.28 其他资产构成

5.8.29 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.30 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.31 其他资产构成

5.8.32 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.33 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.34 其他资产构成

5.8.35 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.36 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.37 其他资产构成

5.8.38 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.39 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.40 其他资产构成

5.8.41 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.42 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.43 其他资产构成

5.8.44 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.45 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.46 其他资产构成

5.8.47 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.48 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.49 其他资产构成

5.8.50 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.51 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.52 其他资产构成

5.8.53 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.54 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.55 其他资产构成

5.8.56 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.57 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.58 其他资产构成

5.8.59 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.60 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.61 其他资产构成

5.8.62 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.63 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.64 其他资产构成

5.8.65 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.66 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.67 其他资产构成

5.8.68 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.69 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.70 其他资产构成

5.8.71 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.72 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.73 其他资产构成

5.8.74 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.75 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.76 其他资产构成

5.8.77 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.78 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.79 其他资产构成

5.8.80 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.81 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.82 其他资产构成

5.8.83 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.84 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.85 其他资产构成

5.8.86 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.87 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.88 其他资产构成

5.8.89 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.90 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.91 其他资产构成

5.8.92 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.93 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.94 其他资产构成

5.8.95 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.96 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.97 其他资产构成

5.8.98 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.99 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.100 其他资产构成

5.8.101 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.102 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.103 其他资产构成

5.8.104 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.105 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.106 其他资产构成

5.8.107 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.108 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.109 其他资产构成

5.8.110 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.111 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.112 其他资产构成

5.8.113 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.114 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.115 其他资产构成

5.8.116 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.117 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.118 其他资产构成

5.8.119 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.120 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.121 其他资产构成

5.8.122 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.123 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.124 其他资产构成

5.8.125 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.126 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.127 其他资产构成

5.8.128 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.129 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.130 其他资产构成

5.8.131 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.132 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.133 其他资产构成

5.8.134 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.135 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.136 其他资产构成

5.8.137 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.138 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.139 其他资产构成

5.8.140 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.141 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.142 其他资产构成

5.8.143 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.144 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.145 其他资产构成

5.8.146 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.147 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.148 其他资产构成

5.8.149 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.150 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.151 其他资产构成

5.8.152 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.153 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.154 其他资产构成

5.8.155 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.156 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.157 其他资产构成

5.8.158 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.159 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.160 其他资产构成

5.8.161 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.162 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.163 其他资产构成

5.8.164 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.165 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.166 其他资产构成

5.8.167 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.168 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.169 其他资产构成

5.8.170 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.171 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.172 其他资产构成

5.8.173 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.174 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.175 其他资产构成

5.8.176 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.177 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.178 其他资产构成

5.8.179 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.180 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8.181 其他资产构成

5.8.182 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.183 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8