华宝兴业先进成长股票型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012年12月31日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
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。

本报告中财务资料未经审计。

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	华宝兴业先进成长股票
基金主代码	240009
交易代码	240009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月7日
报告期末基金份额总额	1,800,740,393.86份
投资目标	分享我国经济增长方式转变过程中和转变完成后的先进企业的成长,在控制风险的前提下为基金份额持有人谋求长期超额回报。
投资策略	本基金将使用定量与定性相结合的方法,选择具备创新能力强、注重资源节约与环境友好、充分发挥人力资源优势这三个先进因素之一的企业进行投资,重点关注国家产业结构调整中鼓励类行业,同时也兼顾有先进企业的传统行业。
业绩比较基准	新上证综指收益率。
风险收益特征	本基金是一只积极型的股票投资基金,属于证券投资基金中的较高风险品种。
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-15,638,720.88
2.本期利润	87,230,784.32
3.加权平均基金份额本期利润	0.0607
4.期末基金资产净值	2,304,370,479.30
5.期末基金份额净值	1.2797

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。

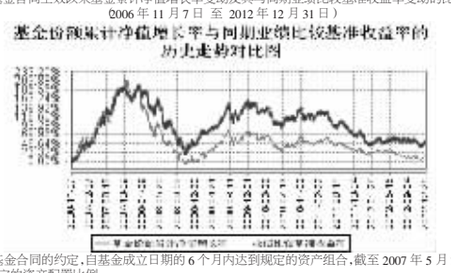
3.2 基金净值表现

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

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	2.88%	1.06%	8.79%	1.10%	-5.91%	-0.04%

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

(2006年11月7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2007年5月7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		
李靖	本基金基金经理	2011年2月11日	-	12年	博士。1999年至2000年任和君创业投资有限公司研究员,2000年至2010年在光大证券有限公司先后任行业研究员、策略研究员、投资经理和定向理财部副总经理的职务。2010年7月加入华宝兴业基金管理有限公司任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理助理,2010年9月至2012年1月任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理,2011年2月起任华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金经理。
朱亮	本基金基金经理	2012年6月1日	-	6年	硕士。曾于信多利科技(中国)有限公司任产品总监,于国金证券股份有限公司任研究员。2008年7月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后任研究部高级分析师、国内投资部华宝兴业增盈收益债券型证券投资基金基金经理助理,华宝兴业宝康消费品证券投资基金基金经理助理,华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金经理助理,2012年6月至今任华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金经理。

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、《华宝兴业先进成长股票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。

由于分红和申购赎回引起的基金资产规模变化,先进成长基金在短期内出现过持有的股票市值占基金资产净值比低于60%的情况。发生此类情况后,该基金均在合理期限内得到了调整,没有给投资人带来额外风险或损失。

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,分析了本基金与公司旗下所有其他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

今年四季度市场在经过前期较大的调整后的一波短暂上升后进入平台整理,随后开始破位下跌,并创出了全年新低,随后才出现V型反弹,从12月初开始一路上涨直至年终,最终将年线收到了红盘。

四季度前期受塑化剂影响,白酒行业出现行业性的暴跌,同时带动前期超额收益较高的消费行业调整,引领市场向下破位,创出年内新低。稍作缓和之后,市场终于报复性反弹,在银行地产的引领下一路带动指数上扬。

此时的十八大结束,新领导上任,在对新一届领导班子的期许之下,加之估值水平已经处在历史低位以及跌幅巨大等多重因素的合力之下,市场出现反弹。

本基金在四季度基本保持组合均衡,在11月前已经将组合仓位降低到最低水平,因此规避了一部分风险。在12月以后随市场的起来,本组合还是加入金融地产,因此基本在12月也跟上了市场涨幅。直至年底,本基金已经将组合仓位调整到中等偏上水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本报告期内基金份额净值增长率为2.88%,业绩比较基准收益率为8.79%,基金落后业绩基准5.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来的市场,我们认为需要观察国内PPI及CPI数据,经济复苏与否将决定下一期资产配置重点,也决定未来一年的仓位和投资方向。改革是最大的红利,下一期伴随的证券市场诸多问题的逐渐解决和规范,即便市场环境稍微恶劣一些,但在改革的推动下也会在板块出现局部机会。下一阶段,主要配置还需围绕着低估值蓝筹股同时在符合国家政策的行业上加大配置力度,精选个股,波段操作。

§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	1,920,696,175.18	82.59
	其中:股票	1,920,696,175.18	82.59
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	371,667,957.89	15.98
6	其他资产	33,114,442.67	1.42
7	合计	2,325,478,575.74	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	7,560,926.11	0.33
B	采掘业	36,883,576.70	1.60
C	制造业	917,811,119.27	39.83
C0	食品、饮料	87,344,558.78	3.79
C1	纺织、服装、皮毛	36,443,216.42	1.58
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	8,431,841.90	0.37
C4	石油、化学、塑胶、塑料	75,429,230.39	3.27
C5	电子	252,245,255.63	10.95
C6	金属、非金属	108,277,211.41	4.70
C7	机械、设备、仪表	202,106,926.93	8.77
C8	医药、生物制品	147,532,877.81	6.40
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	171,000,523.06	7.42
F	交通运输、仓储业	9,537,503.61	0.41
G	信息技术业	108,313,476.02	4.70
H	批发和零售贸易	77,581,492.80	3.37
I	金融、保险业	275,055,634.56	11.94
J	房地产业	227,147,128.10	9.86
K	社会服务业	69,075,213.20	3.00
L	传播与文化产业	20,658,471.75	0.90
M	综合类	71,110.00	0.00
合计		1,920,696,175.18	83.35

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	002049	同方国芯	3,447,436	75,257,527.88	3.27
2	300088	长信科技	4,510,628	68,561,545.60	2.98
3	600000	浦发银行	5,999,977	59,519,771.84	2.58
4	300005	探路者	3,449,781	58,991,255.10	2.56
5	002375	亚厦股份	1,952,718	51,707,972.64	2.24
6	600048	保利地产	3,619,755	49,228,668.00	2.14
7	600703	三安光电	3,464,919	47,400,091.92	2.06
8	600809	山西汾酒	1,074,691	44,771,627.06	1.94
9	300070	碧水源	1,106,537	44,372,133.70	1.93
10	601669	中国水电	10,063,481	38,442,497.42	1.67

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,027,176.14
2	应收证券清算款	31,949,848.68
3	应收股利	-
4	应收利息	96,407.80
5	应收申购款	41,010.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,114,442.67

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	1,003,891,136.08
本报告期基金总申购份额	1,083,274,896.54
减:本报告期基金总赎回份额	286,425,638.76
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,800,740,393.86

注:总申购份额含红利再投资和转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;
华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金合同;
华宝兴业先进成长股票型证券投资基金招募说明书;
华宝兴业先进成长股票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。

7.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人住所备投资者查阅。

7.3 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1月21日

华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金

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

§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。

本报告中财务资料未经审计。

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
基金主代码	240002
交易代码	240002
基金运作方式	契约型开放式
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	规避系统风险,降低投资组合波动性,提高投资组合的长期报酬。
投资策略	本基金采用资产灵活配置策略,以债券投资为基础,并把握股市重大投资机会,获取超额回报,同时执行严格的投资制度和风险控制制度。
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。 复合指数=(上证180流通市值/成分指数总流通市值)×上证180指数+(深证100流通市值/成分指数总流通市值)×深证100指数成分指数总流通市值=上证180流通市值+深证100流通市值
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

§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(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。

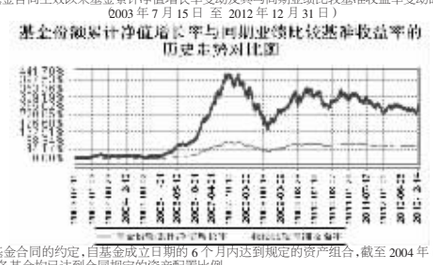
3.2 基金净值表现

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

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	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,本系列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

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		
郭鹏飞	国内投资部总经理、本基金基金经理、华宝兴业新兴产业股票基金经理	2010年6月26日	-	8年	博士,拥有CFA资格。2004年2月加入华宝兴业基金管理有限公司任研究部行业分析师,2007年9月任公司研究部副总经理,2009年3月至2010年6月任公司研究部总经理,2010年6月至今任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理,2010年12月兼任华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金经理,2012年4月起任国内投资部总经理。

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、《华宝兴业宝康系列开放式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,分析了本基金与公司旗下所有其他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

回顾2012四季度,中国经济在经历了两年多的增速下降之后,开始出现明显的探底企稳迹象;同时,十八大的顺利召开,以及新一届领导人所表现出来的务实作风和改革决心,也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,欧债危机暂时有所缓解,海外市场持续走强;国内经济在房地产恢复和国家基建投资的拉动下,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月底即迅速收复了2250点。四季度期间,上证综指和沪深300指数分别上涨8.77%和10.02%,中小板指数下跌0.66%,创业板指数上涨3.51%。总体而言,大盘股和周期股表现优于中小盘股及消费类股。分行业来看,各行业板块指数表现差异很大,其中房地产、交运设备、建筑建材、金融服务、家用电器指数的涨幅都在20%以上,而食品饮料、餐饮旅游、信息服务、信息设备、有色金属录得负收益,行业表现靠后。

我们在四季度坚持逢低加仓,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中上游。

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%,业绩比较基准增长率为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简要展望

展望2013年一季度,中国经济有望继续企稳并小幅回升,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,投资者对经济前景的预期将更加明朗。我们认为,四季度末的市场强势反弹已经对经济企稳和市场信心的恢复做出了较好的反应,短期看这一趋势仍将延续。

因此,我们计划继续采取积极的投资策略,总体维持较高水平的股票仓位,以把握可能出现的系统性投资机会,配置上仍以指数权重股为主,阶段性把握周期品反弹的机会,同时继续长期持有部分受益于经济结构转型的高成长性股票。感谢基金持有人一直以来对我们的支持,在以后的投资中,我们将继续勤勉尽责,努力为持有人创造好的回报。

§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	586,262,347.41	73.38
	其中:股票	586,262,347.41	73.38
2	固定收益投资	174,889,216.10	21.89
	其中:债券	174,889,216.10	21.89
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	25,898,055.54	3.24
6	其他资产	11,927,550.33	1.49
7	合计	798,977,169.38	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	2,704,191.42	0.34
B	采掘业	49,427,072.48	6.21
C	制造业	208,276,709.99	26.16
C0	食品、饮料	28,473,281.39	3.58
C1	纺织、服装、皮毛	1,393,656.70	0.18
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	722,726.55	0.09
C4	石油、化学、塑胶、塑料	14,929,920.68	1.88
C5	电子	8,131,506.68	1.02
C6	金属、非金属	32,603,768.26	4.10
C7	机械、设备、仪表	100,680,094.75	12.65
C8	医药、生物制品	21,214,709.93	2.66
C99	其他制造业	127,045.05	0.02
D	电力、煤气及水的生产和供应业	11,040,477.31	1.39
E	建筑业	17,623,120.97	2.21
F	交通运输、仓储业	12,042,010.98	1.51
G	信息技术业	14,779,808.93	1.86
H	批发和零售贸易	43,891,781.36	5.51
I	金融、保险业	144,789,144.50	18.19
J	房地产业	30,911,275.89	3.88
K	社会服务业	42,447,576.18	5.33
L	传播与文化产业	1,717,372.80	0.22
M	综合类	6,611,804.60	0.83
合计		586,262,347.41	73.64

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	300070	碧水源	945,143	37,900,234.30	4.76
2	002503	搜于特	984,873	24,129,388.50	3.03
3	002358	森源电气	1,432,207	17,386,992.98	2.18
4	600016	民生银行	2,040,784	16,040,562.24	2.01
5	600036	招商银行	1,119,543	15,393,716.25	1.93
6	300257	开山股份	410,771	14,171,599.50	1.78
7	300124	汇川技术	574,531	13,760,017.45	1.73
8	601318	中国平安	302,476	13,699,138.04	1.72
9	601166	兴业银行	683,470	11,407,114.30	1.43
10	601328	交通银行	2,076,072	10,255,795.68	1.29

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	4,469,216.10	0.56
2	央行票据	59,952,000.00	7.53
3	金融债券	110,468,000.00	13.88
	其中:政策性金融债	110,468,000.00	13.88
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	174,889,216.10	21.97

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	080215	08国开15	500,000	50,460,000.00	6.34
2	1001042	10央行票据42	500,000	49,965,000.00	6.28
3	120218	12国开18	300,000	30,012,000.00	3.77
4	120405	12农发05	200,000	20,010,000.00	2.51
5	1001060	10央行票据60	100,000	9,987,000.00	1.25

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 投资组合报告附注

5.8.1 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

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	750,000.00
2	应收证券清算款	7,912,024.76
3	应收股利	-
4	应收利息	3,154,664.67
5	应收申购款	110,860.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,927,550.33

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	634,616,003.90
本报告期基金总申购份额	3,251,365.99
减:本报告期基金总赎回份额	19,740,527.03
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	618,126,842.86

注:总申购份额含红利再投资和转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;
华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同;
华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金招募说明书;
华宝兴业宝康系列开放式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。

7.2 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。

7.3 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1月21日

华宝兴业现金宝货币市场基金

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

§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。

本报告中财务资料未经审计。

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	华宝兴业现金宝货币	
基金主代码	240006	
交易代码	240006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年3月31日	
报告期末基金份额总额	3,032,493,462.93份	
投资目标	保持本金的安全性与流动性,追求高于比较基准的收益率。	
投资策略	以对宏观经济及利率走势的判断为基础,在满足组合平均久期、收益性以及信用等级的前提下利用现代金融分析方法和工具,优化组合配置效果,实现组合增值。	
业绩比较基准	同期7天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。	
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	华宝兴业现金宝货币A	华宝兴业现金宝货币B
下属两级基金的交易代码	240006	240007
报告期末下属两级基金的份额总额	902,587,819.61份	2,129,905,643.32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(2012年10月1日-2012年12月31日)	
	华宝兴业现金宝货币A	华宝兴业现金宝货币B
1.本期已实现收益	10,248,107.95	28,566,821.31
2.本期利润	10,248,107.95	28,566,821.31
3.期末基金资产净值	902,587,819.61	2,129,905,643.32

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。由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝兴业现金宝货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.8842%	0.0036%	0.3393%	0.0000%	0.5449%	0.0036%

注:基金收益分配是按日结转份额。

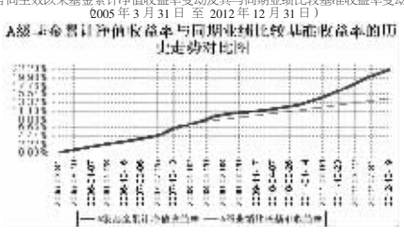
华宝兴业现金宝货币B

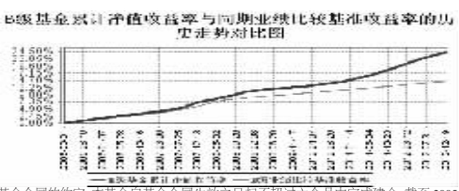
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9452%	0.0036%	0.3393%	0.0000%	0.6059%	0.0036%

注:基金收益分配是按日结转份额。

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

(2005年3月31日 至 2012年12月31日)





注:按照基金合同的约定,本基金自基金合同生效之日起不超过六个月内完成建仓。截至2005年4月7日,本基金已根据基金合同规定完成建仓,资产配置比例符合基金合同约定。

§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		
陈昕	本基金基金经理、华宝兴业中证短融50债券基金基金经理、华宝添益基金基金经理	2011年11月15日	-	8年	经济学学士。2003年7月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后在清算登记部、交易部、固定收益部从事固定收益产品相关的估值、交易、投资工作,2010年7月起任华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理助理,2011年11月至今任华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理,2012年6月兼任华宝兴业中证短融50债券基金基金经理,2012年12月兼任华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金经理。

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、《货币市场基金管理暂行办法》、《华宝兴业现金宝货币市场基金基金合同》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,