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
送出日期:2014年3月31日

华宝兴业宝康债券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013年12月31日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2014年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料已经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2013年01月01日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业宝康债券投资基金
基金简称	华宝兴业宝康债券
基金主代码	240003
交易代码	240003
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
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
报告期末基金份额总额	183,454,263.24份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持投资组合低风险和充分流动性的前提下,确保基金财产安全及追求资产长期稳定增值。
投资策略	本基金将采用类属配置、久期偏离、收益率曲线配置和特定券种选择等积极投资策略,开拓国内市场的新机会。
业绩比较基准	中信标普全债指数。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝兴业基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	田青
	联系电话	021-38505888	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588,021-38924558	010-67595096
传真		021-38505777	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金年度报告备置地点	本基金年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	11,206,768.56	5,487,029.77	-6,442,301.68
本期利润	6,713,918.19	18,750,186.35	-13,334,256.63
加权平均基金份额本期利润	0.0300	0.0792	-0.0551
本期加权平均净值利润率	2.55%	6.89%	-4.82%
本期基金份额净值增长率	2.28%	7.07%	-5.06%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配利润	28,668,434.87	35,089,947.29	22,956,850.73
期末可供分配基金份额利润	0.1563	0.1489	0.1033
期末基金资产净值	214,258,189.35	278,339,118.30	245,179,231.47
期末基金份额净值	1.1679	1.1813	1.1033
3.1.3 累计期末指标	2013年末	2012年末	2011年末
基金份额累计净值增长率	88.99%	84.78%	72.58%

注:1、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。

2、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。

3、净值相关数据计算中涉及天数的,包括所有交易日以及季末最后一自然日(如非交易日)。

4、期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

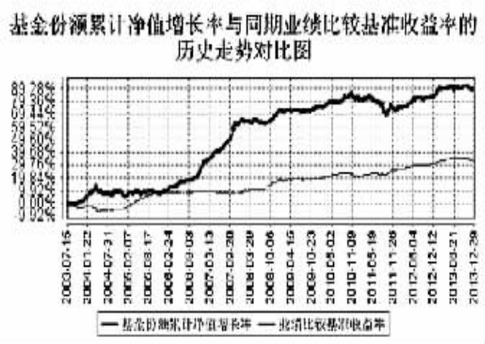
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.35%	0.12%	-1.26%	0.06%	-0.15%	0.06%
过去六个月	-0.54%	0.11%	-0.82%	0.05%	0.28%	0.06%
过去一年	2.28%	0.16%	1.78%	0.05%	0.50%	0.11%
过去三年	3.97%	0.19%	9.89%	0.05%	-5.92%	0.14%
过去五年	9.70%	0.17%	12.39%	0.06%	-2.69%	0.11%
自基金合同生效日起至今	88.99%	0.22%	33.42%	0.08%	55.57%	0.14%

注:1、本基金业绩比较基准为:中信标普全债指数。

2、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的,包括所有交易日以及季末最后一自然日(如非交易日)。

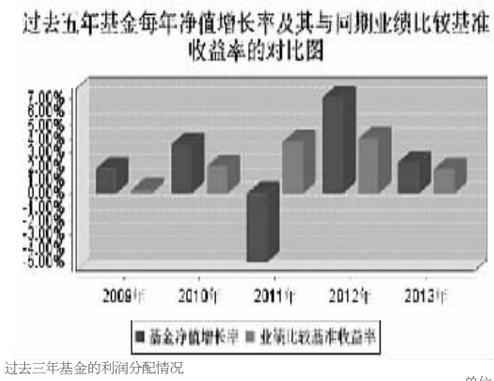
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2003年7月15日至2013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,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013	0.4000	6,286,099.23	3,544,124.95	9,830,224.18	
2012	-	-	-	-	
2011	0.2000	1,583,521.11	4,083,348.21	5,666,869.32	
合计	0.6000	7,869,620.34	7,627,473.16	15,497,093.50	

注:本基金的基金管理人于2014年1月13日宣告2013年度第一次分红,向截至2014年1月16日止在本基金注册登记人华宝兴业基金管理有限公司登记在册的全体持有人,按每10份基金份额派发红利0.1000元。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人是2003年3月7日正式成立的合资基金管理公司,截至本报告期末(2013年12月31日),所管理的开放式证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、增强收益基金、中证100 基金、上证180价值ETF、上证180价值ETF 联接基金、新兴产业基金、成熟市场动量优选基金、可转债基金、上证180成长ETF、上证180成长ETF联接基金、华宝油气基金、华宝兴业医药生物基金、华宝短融50基金、华宝兴业资源优选基金、华宝添益基金和华宝兴业服务优选基金,所管理的开放式证券投资基金资产净值合计42,053,592,319.43元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李核梁	本基金基金经理	2011年6月28日	-	10年	硕士,曾在国联证券有限责任公司、华宝信托有限责任公司和太平资产管理有限公司从事固定收益的研究和投资,2010年9月加入华宝兴业基金管理有限公司担任债券分析师,2010年12月至2011年6月任华宝兴业宝康债券基金经理助理,2011年6月起担任华宝兴业宝康债券基金经理。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人从研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节出发制定了公司内部的公平交易制度以确保公司所有投资组合在各个环节得到公平的对待。公平交易制度和控制方法适用公司管理所有投资组合(包括公募基金、特定客户资产管理组合),对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

研究分析方面,公司使用统一的投资研究管理系统,并规定所有与投资业务相关的研究报告和股票入库信息必须在该系统中发表和存档。同时,该系统对所有投资组合经理设置相同的使用权限。

授权和投资决策方面,投资组合经理在其权限范围内的投资决策保持独立,并对其投资决策的结果负责。通过各个系统的权限设置使投资组合经理仅能看到自己的组合情况。

交易执行方面,所有投资组合的投资指令必须通过交易系统分发和执行。对于交易所公开竞价交易,交易系统内置公平交易执行程序。公司内部制度规定此类交易指令需执行公平交易程序,由交易部负责人负责执行。针对其他不能通过系统执行公平交易程序且必须以公司名义统一进行交易的指令,公司内部制定相关制度流程以确保此类交易的公允分配。同时,公司根据法规要求在交易系统中设置一系列投资禁止与限制指标对公平交易的执行进行事前控制,主要包括限制公司旗下组合自身及组合间反向交易、对敲交易、银行间关联方交易等。

事后监督,公司的风险管理部作为独立第三方对所有投资行为进行事后监督,主要监督的事项包括以下内容。

1)每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析。

2)每季度和每年度对公司管理的不同投资组合所有交易所二级市场交易进行1日、3日、5日同向交易价差分析。

3)对公司管理的不同投资组合的所有银行间债券买卖和回购交易进行分析。监督的内容包括以下几点,同一投资组合短期内对同一债券的反向交易,债券买卖到期收益率与中债登估价收益率之间的差异,回购利率与当日市场平均利率之间的差异。对上述监督内容存在异常的情况要求投资组合经理进行合理性解释。

4)对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程的公允性进行监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

2013年全年基金管理人严格遵守公司内部制定的公平交易制度和控制方法,确保了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。公司内部制定的公平交易制度涉及的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

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,分析了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;并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下(1日、3日、5日)同向交易的样本,对其进行95%置信区间下的假设检验分析,同时结合各组合的成交金额,并参考市场成交量等因素综合判断是否存在不公平交易、利益输送的可能。分析结果未发现异常情况。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年固定资产投资增速1、2季度下滑,3季度稳定,4季度再度下滑,全年累计增长19.6%,其中制造业投资增速走势和固定资产投资增速走势完全一致,房地产投资增速基本保持稳定,基建投资增速波动较大。2013年进出口增速保持稳定。2013年消费增速稳定。经济增速随着固定资产投资增速的波动而波动,全年增长7.7%。物价水平上半年平稳,3季度上升,4季度再度下降,2013年全国居民消费价格总水平比上年上涨2.6%。2013年年初货币信贷增速较快,央行持续控制货币信贷增速,控制表外业务风险。2013年1-5月份债券持续上涨,6月份第一次钱荒导致债券收益率快速上升,7月份债券收益率微幅回落之后踏上了漫漫熊途,货币市场收益率上升,利率债收益率上升,信用债收益率上升。可转债的走势和经济走势基本一致,年初转债快速大幅上扬,2季度转债大幅度下跌,3季度反弹随后继续下跌。

宝康债券基金按照契约规定配置了超过20%的利率产品,4季度加大了利率债的配置比例;4季度降低了信用债的投资比例;2季度末增加了可转债的投资比例,3季度减持了可转债。宝康债券基金上半年因信用债配置比例较低、业绩相对落后,下半年通过降低信用债投资比例和久期以及通过可转债交易,改善了业绩。

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2.28%,同期业绩比较基准收益率为1.78%,基金表现领先业绩比较基准0.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中央经济工作会议定调2014年的经济发展目标和政策措施,会议指出要坚持稳中求进、改革创新。要稳扎稳打,步步为营,巩固稳中向好的发展态势,促进经济社会大局稳定,为全面深化改革创造条件,通过改革释放经济增长动力。会议指出要继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策,货币政策方面要保持适度流动性,保持货币信贷和社会融资总量的合理增长。中央经济工作会议要求保持经济增速在合理区间平稳运行和物价稳定。2013年利率市场化的加速提高了金融机构负债端的成本,提高了货币市场收益率,并推高了中长期无风险利率和信用类资产的收益率,全社会融资成本的上升可能降低未来经济增速,政府在经济增速接近下限目标时采取何种措施稳增长可能是大类资产转换的最主要影响因素。2014年的经济增速可能低于2013年,物价水平较为稳定。

2014年债券市场将受制于高企的货币市场收益率,期间货币市场收益率的波动、货币政策的调整、债券的供求等可能带来交易的机会。长期限利率债可能存在交易机会。信用债包括城投类债券的潜在供给压力较大、不同行业之间的分化加剧,信用风险发生的概率在上升,信用债的投资需要谨慎。可转债的分化可能较为明显,部分不能下调转股价的转债将向纯债靠拢,转债投资要获取收益需要关注股性较强的转债以及存在条款博弈可能的转债。总的来说市场依然存在不确定性,我们会密切关注经济和政策的变化,分析其对大类资产配置的影响,以改善业绩。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司自2003年3月成立以来始终注重合规性和业务风险控制。加强对基金运作的内部操作风险控制、保障基金份额持有人的利益始终是公司制定各项内部制度、流程的指导思想。公司监察稽核部门对公司遵守各项法规和管理制度及公司所管理的各基金履行合同义务的情况进行核查,发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改,同时定期向监管部门、公司管理层及上级公司出具相关报告。

本报告期内,基金管理人内部监察稽核主要工作如下:

(一)规范员工行为操守,加强职业道德教育和风险教育。公司通过对新员工集中组织岗前培训、签署《个人声明书》等形式,明确员工的行为准则,防范道德风险。并在具体工作中坚持加强法规培训,努力培养员工的风险意识、合法合规意识。

(二)完善公司制度体系。公司一方面坚持制度的刚性,不轻易改变、简化已确立的流程。要求从一般员工、部门经理到业务总监,每个人都必须清楚自己的权力和职责,承担相应责任。另一方面,伴随市场变革和产品创新,公司的业务和管理方式也发生着变化。在长期的业务实践中,公司借鉴和吸收海外股东、国内同行经验,在符合公司基本制度的前提下,根据业务的发展不时调整。允许各级员工在职责范围内设计和调整自己的业务流程,涉及其它部门或领域的,由相应级别的负责人在符合公司已有制度的基础上协调和批准。公司根据法律法规的变化、监管要求和业务情况不断调整和细化市场、营运、投资研究各方面的分工和业务规则,并根据内部控制委员会和监察稽核部门提出的意见、建议调整或改善了前、中、后台的业务流程。

(三)有重点地全面开展内部审计稽核工作。2013年,监察稽核部门按计划对公司营运、投资、市场部门进行了业务审计,加强了防控内幕交易等行为的稽核力度;并与相关部门进行沟通,形成后续跟踪和业务上相互促进的良性循环,不断提高工作质量。

在今后的工作中,本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念,完善内控制度,提高工作水平,努力防范和控制各种风险,保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人在报告期内对旗下基金估值过程中,公司内部参与估值流程的各方职责分工如下:

(一)基金会计:根据《基金会计核算业务指引》对基金日常交易进行记账核算,并对基金投资品种进行估值。

(二)量化投资部:对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况下,根据估值委员会对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法(比如:指数收益法)进行估值,并在估值时兼顾考虑行业研究员提供的根据上市公司估值模型计算的结果所提出的建议或意见。

(三)估值委员会:定期评价现行估值政策和程序,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。基金在采用新投资策略或投资新品种时,评价现有估值政策和程序的适用性。

(四)必要时基金经理就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见,但由估值委员会做最终决策。

上述参与估值流程的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力,参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规及基金合同的规定,本基金于2014年1月13日发布了分红公告,本次分红为2013年度的第1次分红。本基金向2014年1月16日在本基金注册登记机构登记在册的基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.1000元,利润分配合计为人民币1,734,758.71元,其中现金形式发放总额为人民币1,301,553.87元,再投资形式发放总额为人民币433,204.84元。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人,基金管理人在合理期限内进行了调整,对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内,本基金实施利润分配的金额为9830224.18元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:华宝兴业宝康债券投资基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资产:			
银行存款		2,516,175.90	3,268,964.01
结算备付金		1,677,435.22	1,773,755.27
存出保证金		67,195.96	250,000.00
交易性金融资产		235,089,367.19	307,879,480.96
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		235,089,367.19	307,879,480.96
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		4,284,936.43	5,720,039.97
应收利息		3,436,703.37	3,888,272.55
应收股利		-	-
应收申购款		74,596.13	76,679.27
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		247,146,410.20	322,857,192.03
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		29,000,000.00	40,000,000.00
应付证券清算款		-	670,888.61
应付赎回款		138,640.31	255,624.02
应付管理人报酬		112,448.75	140,749.70
应付托管费		37,482.92	46,916.58
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		713,672.03	516,850.76
应交税费		2,462,189.66	2,432,767.10
应付利息		16,832.76	9,914.56
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		406,954.42	444,362.40
负债合计		32,888,220.85	44,518,073.73
所有者权益:			
实收基金		183,454,263.24	235,618,694.09
未分配利润		30,803,926.11	42,720,424.21
所有者权益合计		214,258,189.35	278,339,118.30
负债和所有者权益总计		247,146,410.20	322,857,192.03

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.1679元,基金份额总额183,454,263.24份。

7.2 利润表

会计主体:华宝兴业宝康债券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入		11,100,537.03	22,666,794.96
1.利息收入		12,784,965.96	11,536,636.92
其中:存款利息收入		86,157.63	93,307.10
债券利息收入		12,388,609.13	11,420,393.77
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		310,199.20	22,936.05
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		2,681,929.55	-2,230,656.18
其中:股票投资收益		-	-1,436,574.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益		2,681,929.55	-794,081.95
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-4,492,850.37	13,263,156.58
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		126,491.89	97,657.64
减:二、费用		4,386,618.84	3,916,608.61
1. 管理人报酬		1,585,635.05	1,632,926.10
2. 托管费		528,544.98	544,308.73
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		249,551.50	141,996.13
5. 利息支出		1,846,888.32	1,420,373.29
其中:卖出回购金融资产支出		1,846,888.32	1,420,373.29
6. 其他费用		175,998.99	177,004.36
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		6,713,918.19	18,750,186.35
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		6,713,918.19	18,750,186.35

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华宝兴业宝康债券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	235,618,694.09	42,720,424.21	278,339,118.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,713,918.19	6,713,918.19
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-52,164,430.85	-8,800,192.11	-60,964,622.96
其中:1.基金申购款	44,187,392.52	7,983,126.73	52,170,519.25
2.基金赎回款	-96,351,823.37	-16,783,318.84	-113,135,142.21
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-9,830,224.18	-9,830,224.18
五、期末所有者权益(基金净值)	183,454,263.24	30,803,926.11	214,258,189.35

项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	222,222,380.74	22,956,850.73	245,179,231.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	18,750,186.35	18,750,186.35
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	13,396,313.35	1,013,387.13	14,409,700.48
其中:1.基金申购款	101,316,363.87	13,434,389.98	114,750,753.85
2.基金赎回款	-87,920,050.52	-12,421,002.85	-100,341,053.37
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	235,618,694.09	42,720,424.21	278,339,118.30

注:报告期末及上年度可比期间未除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	2,516,175.90	39,272.60	3,268,964.01	59,018.69

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有的暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购,因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年12月31日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额29,000,000.00元,于2014年1月2日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2013年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为187,186,367.19元,属于第二层级的余额为47,903,000.00元,无属于第三层级的余额(2012年12月31日:第一层级227,874,480.96元,第二层级80,005,000.00元,无第三层级)。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	235,089,367.19	95.12
	其中:债券	235,089,367.19	95.12
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,193,611.12	1.70
7	其他各项资产	7,863,431.89	3.18
8	合计	247,146,410.20	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

8.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期未买入股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期未卖出股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期无股票投资。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	30,350,000.00	14.17
2	央行票据	19,942,000.00	9.31
3	金融债券	9,293,000.00	4.34
	其中:政策性金融债	9,293,000.00	4.34
4	企业债券	150,756,718.10	70.36
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	24,747,649.09	11.55
8	其他	-	-
9	合计	235,089,367.19	109.72

8.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1101032	11央行票据32	200,000	19,942,000.00	9.31
2	100019	10附息国债19	200,000	18,668,000.00	8.71
3	122080	11康美债	169,180	16,576,256.40	7.74
4	122775	11成城投	151,100	15,230,880.00	7.11
5	122911	10鞍城投	149,300	14,661,260.00	6.84

8.7 期末按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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按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

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

8.10.2 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。

8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

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。

8.11.2

本基金本报告期末未持有股票投资。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	67,195.96
2	应收证券清算款	4,284,936.43
3	应收股利	-
4	应收利息	3,436,703.37
5	应收申购款	74,596.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,863,431.89

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	10,618,300.00	4.96
2	110018	国电转债	3,094,500.00	1.44
3	110015	石化转债	2,918,016.00	1.36
4	113002	工行转债	1,599,303.00	0.75
5	113001	中行转债	1,444