

# 兴业可转债混合型证券投资基金 2007年第二季度报告

## 一、重要提示

本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。

本基金的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2007年7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。

本报吿书财务数据未经审计师审计。本报吿书自2007年4月1日起至2007年6月30日止。

## 二、基金产品概况

基金名称：兴业可转债混合型证券投资基金

基金简称：兴业可转债

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2004年5月11日

基金类型：混合型基金

基金代码：0011309607份

投资目标：在锁定组合仓位分仓的基础上，以有限的期权成本获取基金资产的长期稳定增值。

投资策略：基金的资产配置主要采用自下而上的程序，并严格控制投资风险。

本基金选择的股票具有良好发展前景，预期收益水平高于市场平均水平的股票进行投资。

基金经理对行业进行深入的分析，以“投资价值”判断为标准，选择所处行业发展前景良好的股票进行投资，实现投资风险的降低。

本基金的资产配置主要通过主动的金融工具，包括国内依法公开发行上市的可转换债券、公司债券、短期融资券、以及法律法规规定的其他金融工具。

风险收益特征：80%× 天相可转债指数 + 15% × 中信标普300指數 + 5% × 同业存款利率

风险收益特征：兴业可转债混合型证券投资基金

基金管理人：兴业基金管理有限公司

注册登记机构：兴业基金管理有限公司

（一）主要财务指标（未经审计）

2007年2季度主要财务指标 单位：人民币元

序号	项目	金额
1	基金本期净收益	577,353,676.57
2	加权平均基金份额本期净收益	0.2913
3	期末基金份额净值	3,099,938,336.42
4	期末基金份额净值	15026

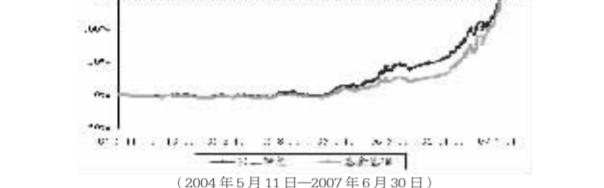
（二）基金净值表现

1.本报告期末基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段 净值增长率① 净值增长差额② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 31.01% 120% 22.96% 2.01% 8.05% -0.81%

2.基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1. 净值表现所取数据截至2007年6月30日  
2. 按照《兴业可转债混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金应自2004年5月11日成立

起六个月内，达到本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围，目前本基金符合基金合同规定的比例限制及投资组合的比例限制。

3. 所述基金费用不包括持有人认购或申购基金的各项费用（例如：申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等）。

## 四、基金管理人

（一）基金管理人介绍

杨光先生，1974年生，计算数学硕士，历任上海万国证券研究所金融工程部，主要从事可转债研究及申万债券数据的研究，兴业可转债混合型证券投资基金的基金经理。现任兴业可转债混合型证券投资基金的基金经理。

基金经理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。

本报吿书财务数据未经审计师审计。本报吿书自2007年4月1日起至2007年6月30日止。

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末，本基金主要投资于以下行业：农林、牧、渔业；采掘业；制造业；食品、饮料；纺织、服装、皮革；造纸、印刷；石油、化学、塑胶、塑料；电子；金属、非金属；机械设备；医药、生物制品；其他制造业；电力、煤气及水的生产和供应业；建筑业；交通运输、仓储业；信息技术业；批发和零售贸易；金融、保险业；房地产业；社会服务业；传播与文化产业；综合类。

（三）报告期末按行业分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有按行业分类的债券投资。

（四）报告期末按品种分类的股票投资组合

报告期末，本基金未持有按品种分类的股票投资。

（五）报告期末按品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有按品种分类的债券投资。

（六）报告期末按品种分类的贵金属投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的贵金属投资。

（七）报告期末按品种分类的权证及衍生品投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的权证及衍生品投资。

（八）报告期末按品种分类的股指期货投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的股指期货投资。

（九）报告期末按品种分类的国债期货投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的国债期货投资。

（十）报告期末按品种分类的资产支持证券投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的资产支持证券投资。

（十一）报告期末按品种分类的其他投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的其他投资。

（十二）报告期末按品种分类的股票投资组合

报告期末，本基金未持有按品种分类的股票投资组合。

（十三）报告期末按品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有按品种分类的债券投资组合。

（十四）报告期末按品种分类的贵金属投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的贵金属投资。

（十五）报告期末按品种分类的权证及衍生品投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的权证及衍生品投资。

（十六）报告期末按品种分类的股指期货投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的股指期货投资。

（十七）报告期末按品种分类的国债期货投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的国债期货投资。

（十八）报告期末按品种分类的资产支持证券投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的资产支持证券投资。

（十九）报告期末按品种分类的其他投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的其他投资。

（二十）报告期末按品种分类的股票投资组合

报告期末，本基金未持有按品种分类的股票投资组合。

（二十一）报告期末按品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有按品种分类的债券投资组合。

（二十二）报告期末按品种分类的贵金属投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的贵金属投资。

（二十三）报告期末按品种分类的权证及衍生品投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的权证及衍生品投资。

（二十四）报告期末按品种分类的股指期货投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的股指期货投资。

（二十五）报告期末按品种分类的国债期货投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的国债期货投资。

（二十六）报告期末按品种分类的资产支持证券投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的资产支持证券投资。

（二十七）报告期末按品种分类的其他投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的其他投资。

（二十八）报告期末按品种分类的股票投资组合

报告期末，本基金未持有按品种分类的股票投资组合。

（二十九）报告期末按品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有按品种分类的债券投资组合。

（三十）报告期末按品种分类的贵金属投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的贵金属投资。

（三十一）报告期末按品种分类的权证及衍生品投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的权证及衍生品投资。

（三十二）报告期末按品种分类的股指期货投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的股指期货投资。

（三十三）报告期末按品种分类的国债期货投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的国债期货投资。

（三十四）报告期末按品种分类的资产支持证券投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的资产支持证券投资。

（三十五）报告期末按品种分类的其他投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的其他投资。

（三十六）报告期末按品种分类的股票投资组合

报告期末，本基金未持有按品种分类的股票投资组合。

（三十七）报告期末按品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有按品种分类的债券投资组合。

（三十八）报告期末按品种分类的贵金属投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的贵金属投资。

（三十九）报告期末按品种分类的权证及衍生品投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的权证及衍生品投资。

（四十）报告期末按品种分类的股指期货投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的股指期货投资。

（四十一）报告期末按品种分类的国债期货投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的国债期货投资。

（四十二）报告期末按品种分类的资产支持证券投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的资产支持证券投资。

（四十三）报告期末按品种分类的其他投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的其他投资。

（四十四）报告期末按品种分类的股票投资组合

报告期末，本基金未持有按品种分类的股票投资组合。

（四十五）报告期末按品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有按品种分类的债券投资组合。

（四十六）报告期末按品种分类的贵金属投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的贵金属投资。

（四十七）报告期末按品种分类的权证及衍生品投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的权证及衍生品投资。

（四十八）报告期末按品种分类的股指期货投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的股指期货投资。

（四十九）报告期末按品种分类的国债期货投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的国债期货投资。

（五十）报告期末按品种分类的资产支持证券投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的资产支持证券投资。

（五十一）报告期末按品种分类的其他投资

报告期末，本基金未持有按品种分类的其他投资。

（五十二）报告期末按品种分类的股票投资组合

报告期末，本基金未持有按品种分类的股票投资组合。

（五十三）报告期末按品种分类的债券投资组合</