

华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

更新的招募说明书（摘要）

重要提示

本摘要根据《基金合同》和《招募说明书》编写，经基金托管人审核，并经中国证监会核准。《基金合同》是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。投资人自取得依《基金合同》所发售的基金份额，即成为基金份额持有人和《基金合同》当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对《基金合同》的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定享有权利、承担义务；基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅《基金合同》。

投资有风险，投资人申购本基金时应认真阅读《招募说明书》。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

摘要所述内容更新截止至2009年4月7日，有关财务数据和净值表现截止日为2009年3月31日，财务数据未经审计。

一、 《基金合同》生效日期

本基金自 2008 年 9 月 8 日到 2008 年 9 月 26 日向个人投资者和机构投资者同时发售,《基金合同》于 2008 年 10 月 7 日生效。

二、 基金管理人

(一) 基金管理人概况

基金管理人: 华宝兴业基金管理有限公司

住所: 上海市世纪大道 88 号金茂大厦 48 层

办公地址: 上海市世纪大道 88 号金茂大厦 48 层

法定代表人: 郑安国

总裁: 裴长江

成立日期: 2003 年 3 月 7 日

注册资本: 1.5 亿元

电话: 021-38505888

传真: 021-38505777

联系人: 宋三江

股权结构: 中方股东华宝信托有限责任公司持有 51% 的股份, 外方股东法国兴业资产管理有限公司持有 49% 的股份。

(二) 主要人员情况

1、 基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

郑安国先生, 董事长、博士、高级经济师。历任南方证券有限公司发行部经理、投资部经理、南方证券有限公司投资银行部总经理助理、南方证券有限公司上海分公司副总经理、南方证券公司研究所总经理级副所长、华宝信托投资有限责任公司副总经理、总经理。现任华宝兴业基金管理有限公司董事长。

Christian D' ALLEST 先生, 董事, 法学硕士。曾任法国兴业银行国际部业务经理、国际融资司经理、资本市场司负责人、资产管理司负责人。现任法国兴业资产管理有限公司国际部主任。

袁志刚先生, 独立董事, 博士、教授、博导。法国巴黎社会科学高等研究院(E. H. E. S. S.) 经济学博士毕业, 曾任复旦大学经济学院副教授、教授、经济系系主任。现任复旦大学经济学院院长。

谢荣先生, 独立董事, 博士、教授。曾任上海财经大学助教、讲师、副教授、教授, 毕马威华

振会计师事务所合伙人。现任上海国家会计学院副院长。

吴志攀先生，独立董事，法学博士、教授。曾任北京大学法律系讲师、副教授、教授、博导，经济法教研室副主任、系主任，北京大学法学院院长，北京大学校长助理。现任北京大学副校长。

裴长江先生，董事，总裁，硕士、经济师。曾任上海万国证券公司闸北营业部经理助理、经理，申银万国证券股份有限公司浙江管理总部副总经理，申银万国证券股份有限公司经纪总部副总经理，华宝信托投资有限责任公司投资总监。现任华宝兴业基金管理有限公司总裁。

陆云飞（Denis LEFRANC）先生，董事，文学士，法学士。曾任法国期货市场委员会审计员，法国兴业银行法律顾问，法国兴业银行资本市场及资产管理部副经理，BAREP 资产管理公司（法国兴业银行集团子公司）首席法律顾问，法国兴业资产管理有限公司首席法律顾问，华宝兴业基金管理有限公司常务副总裁。现任法国兴业资产管理（香港）有限公司行政总裁。

陆舜华女士，监事、监事会召集人，法兴资产（香港）首席执行官。

贺桂先先生，监事，毕业于江西财经大学。曾任华宝信托投资有限责任公司研究部副总经理；现任公司营运副总监。

向辉先生，监事，金融学硕士，曾在武汉长江金融审计事务所任副所长、长盛基金管理有限公司市场部工作，现任华宝兴业基金管理有限公司清算登记部总经理、公司营运部副总监。

2、本基金基金经理

冯刚先生，北京大学管理学硕士，证券从业经历 9 年，曾在联合证券有限公司、华安基金管理有限公司、长城证券从事投资、研究、投资银行等工作。2004 年 3 月加入华宝兴业基金管理有限公司，任高级研究员、多策略增长基金基金经理助理。2006 年 6 月起任收益增长基金基金经理。

3、投资决策委员会成员

任志强先生，投资总监、行业精选基金基金经理。

Gabriel Gondard 先生，投资副总监、海外中国成长基金基金经理。

魏东先生，投资副总监、国内投资部总经理、宝康灵活配置基金基金经理、先进成长基金基金经理。

Tan Weisi 先生，固定收益部总经理，宝康债券基金基金经理。

冯刚先生，收益增长基金和大盘精选基金基金经理。

雷勇先生，海外投资管理部总经理。

郭鹏飞先生，研究部总经理。

(三) 基金管理人职责

基金管理人应严格依法履行下列职责：

1、依法募集本基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理本基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制中期和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

12、中国证监会规定的其它职责。

(四) 基金管理人承诺

1、基金管理人将遵守《基金法》、《证券法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行的发生。

2、基金管理人不得从事下列行为：

(1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

(2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；

(3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

(5) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其它行为。

3、基金经理承诺

(1) 依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

(2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；

(3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(五) 基金管理人内部控制制度

1、风险管理体系

本基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规性风险、信誉风险和事件风险（如灾难）。

针对上述各种风险，本公司建立了一套完整的风险管理体系，具体包括以下内容：

（1）搭建风险管理环境。具体包括制定风险管理战略、目标，设置相应的组织机构，建立清晰的责任线路和报告渠道、配备适当的人力资源、开发适用的技术支持系统等内容。

（2）识别风险。辨识公司运作和基金管理中存在的风险。

（3）分析风险。检查存在的控制措施，分析风险发生的可能性及其引起的后果并将风险归类。

（4）度量风险。评估风险水平的高低，既有定性的度量手段，也有定量的度量手段。定性的度量是把风险水平划分为若干级别，每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别进入相应的级别。定量的方法则是设计一些风险指标，测量其数值的大小。

（5）处理风险。将风险水平与既定的标准相对比，对于那些级别较低、在公司所定标准范围以内的风险，控制相对宽松一点，但仍加以定期监控，以防其超过预定标准；而对较为严重的风险，则制定适当的控制措施；对于一些后果可能极其严重的风险，则除了严格控制以外，还准备了相应的应急处理措施。

（6）监视与检查。对已有的风险管理系统进行实时监视，并定期评价其管理绩效，在必要时结合新的需求加以改变。

（7）报告与咨询。建立风险管理的报告系统，使公司股东、公司董事会、公司高级管理人员及监管部门及时而有效地了解公司风险管理状况，并寻求咨询意见。

2、内部控制制度

（1）内部风险控制原则

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门和各级岗位，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

有效性原则。通过设置科学清晰的操作流程，结合程序控制，建立合理的内控程序，保证内部控制制度的有效执行。

独立性原则。公司必须在精简高效的基础上设立能充分满足公司经营运作需要的部门和岗位，各部门和岗位在职能上保持相对独立性；公司固有财产、各项委托基金财产、其他资产分离运作，独立进行。

相互制约原则。内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制约，并通过切实可行的相互制

衡措施来消除内部控制中的盲点。

防火墙原则。公司基金管理、交易、清算登记、信息技术、研究、市场开发等相关部门，应当在物理上和制度上适当隔离；对因业务需要必须知悉内幕信息的人员，应制定严格的批准程序和监督防范措施。

成本效益原则。公司应当充分发挥各部门及每位员工的工作积极性，尽量降低经营运作成本，保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律法规、规章制度和各项规定，并在此基础上遵循国际和行业的惯例制订。

全面性原则。内部控制制度必须涵盖公司经营管理的各个环节，并普遍适用于公司每一位员工，不留有制度上的空白或漏洞。

审慎性原则。公司内部控制的核心是风险控制，内部控制制度的制订要以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

适时性原则。内部控制制度的制订应当具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改或完善。

（2）内部风险控制的要求和内容

内部风险控制要求不相容职务分离、建立完善的岗位责任制和规范的岗位管理措施、建立完善的信息资料保全系统、建立授权控制制度、建立有效的风险防范系统和快速反应机制。

内部风险控制的内容包括投资管理业务控制、市场管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制、档案管理控制、建立保密制度以及内部稽核控制等。

（3）督察长制度

公司设督察长，督察长由公司总经理提名，董事会聘任，并应当经全体独立董事同意。督察长的任免须报中国证监会核准。

督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告，并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长发现基金及公司运作中存在问题时，应当及时告知公司总经理和相关业务负责人，提出处理意见和整改建议，并监督整改措施的制定和落实；公司总经理对存在问题不整改或者整改未达到要求的，督察长应当向公司董事会、中国证监会及相关派出机构报告。

（4）内控审计风险管理制度

内控审计风险管理部依据公司的内部控制制度，在所赋予的权限内，按照所规定的程序和适

当的方法，进行公正客观的检查和评价。

内控审计风险管理部负责调查、评价公司有关部门执行公司各项规章制度的情况；进行日常风险监控工作；负责调查评价公司内控制度的健全性、合理性；评价各项内控制度执行的有效性，对内控制度的缺失提出补充建议；协助评价基金财产风险状况；负责公司主要领导离任前的审计；调查公司内部的经济违法案件等。

3、基金管理人关于内部合规控制声明书

- (1) 本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；
- (2) 本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制。

三、 基金托管人

(一) 基金托管人的基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

变更注册登记日期：2004年8月26日

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

法定代表人：肖钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管及投资者服务部总经理：董杰

托管部门联系人：宁敏

电话：(010) 66594977

传真：(010) 66594942

发展概况：

中国银行业务涵盖商业银行、投资银行和保险三大领域，其中，商业银行业务是中国银行的传统主营业务，包括公司金融业务、个人金融业务及金融市场业务。中国银行提供的公司金融业务包括存款业务、贷款业务、国际结算及贸易融资业务，以及银行汇票、本票、支票、汇兑、银行承兑汇票、委托收款、托收承付、集中支付、支票圈存及票据托管等其他公司金融业务；个人金融业务包括储蓄存款业务、个人贷款业务、个人中间业务、“中银理财”服务、私人银行业务和银行卡业务等；金融市场业务主要包括本外币金融工具的自营与代客业务、本外币各类证券或指数投资业务、债务资本市场业务、代客理财和资产管理业务、金融代理及托管业务等。

中国银行在国内同业中率先引进国际管理技术人才和经营理念，不断向国际化一流大银行的目标迈进，截至 2008 年末，中国银行境内外机构共有 10,789 家，其中内地机构 9,983 家，港澳及境外机构 806 家。内地商业银行部分，一级分行、直属分行 37 家，二级分行 284 家，基层分支机构 9,659 家，是中国国际化程度最高的银行。

截至 2008 年末，中国银行资产总额 69,556.94 亿元，负债总额 64,617.93 亿元，归属于母公司所有者权益合计 4,682.72 亿元，分别比上年末增长 16.01%、16.63%和 10.24%。实现净利润 650.73 亿元，比上年增长 4.93%；实现归属于母公司所有者的净利润 635.39 亿元，同比增长 13.00%；每股收益为 0.25 元，比上年增加 0.03 元。不良贷款率由 3.12%下降至 2.65%。集团年末总市值达到 6,699.97 亿元，列全球上市银行第六位。

多年来中国银行围绕客户需求所做的不懈努力，得到了来自业界、客户和权威第三方的广泛认可。在与国际同业和国内同业的激烈竞争中，凭借雄厚的实力和优良的服务，中国银行脱颖而出，成为北京 2008 年奥运会唯一的银行合作伙伴；自 1990 年以来，中国银行一直荣登《财富》500 强排行榜；2004 至 2008 年，中国银行连续被《环球金融》杂志评为“中国最佳外汇银行”，并评为 2008 年度中国最佳债券和现金管理银行；2008 年，中国银行在《银行家》杂志“世界 1000 家大银行”中排名第 10 位；2008 年中国银行被《财资》评为中国最佳贸易融资银行；2008 年中国银行被《金融亚洲》评为最佳贸易融资银行、最佳外汇交易银行、最佳派息政策承诺奖、亚洲最佳公司（最佳股利政策）；2008 年中国银行被《亚洲货币》杂志和《贸易融资》杂志分别评为中国最佳外汇服务银行和中国本土最佳贸易服务银行；2008 年中国银行被《欧洲货币》评为中国区最佳商业银行、中国区债务资本市场最佳投资银行、香港区最佳商业银行和中国区最佳外汇服务奖；2008 年中国银行再次荣获“优信咨询（Universum）”评选的“最理想雇主奖”。

（二）主要人员情况

肖钢先生，自 2004 年 8 月起任中国银行股份有限公司董事长、党委书记。自 2003 年 3 月起任中国银行董事长、党委书记、行长，自 1996 年 10 月起任中国人民银行行长助理，期间曾兼任中国人民银行计划资金司司长、货币政策司司长、广东省分行行长及国家外汇管理局广东省分局局长。1989 年 10 月至 1996 年 10 月，历任中国人民银行政策研究室副主任、主任、中国外汇交易中心总裁、计划资金司司长等职。肖先生出生于 1958 年 8 月，1981 年毕业于湖南财经学院，1996 年获得中国人民大学法学硕士学位。

李礼辉先生，自 2004 年 8 月起担任中国银行股份有限公司副董事长、党委副书记、行长。2002 年 9 月至 2004 年 8 月担任海南省副省长。1994 年 7 月至 2002 年 9 月担任中国工商银行副行长。1988 年至 1994 年 7 月历任中国工商银行国际业务部总经理、新加坡代表处首席代表、福建省分行副行

长等职。李先生出生于 1952 年 5 月，1977 年毕业于厦门大学经济系财政金融专业，1999 年获得北京大学光华管理学院金融学专业博士研究生学历和经济学博士学位。

李早航先生，自 2004 年 8 月起任本行执行董事。2000 年 11 月加入本行并自此担任本行副行长。于 1980 年 11 月至 2000 年 11 月任职于中国建设银行，曾工作于多个岗位，先后担任分行行长、总行多个部门的总经理及副行长。1978 年毕业于南京信息工程大学。2002 年 6 月起担任中银香港控股非执行董事。

董杰先生，自 2007 年 11 月 27 日起担任中国银行股份有限公司托管及投资者服务部总经理。自 2005 年 9 月起任中国银行天津市分行副行长、党委委员，1983 年 7 月至 2005 年 9 月历任中国银行深圳市分行沙头角支行行长、深圳市分行信贷经营处处长、公司业务处处长、深圳市分行行长助理、党委委员等职。董先生出生于 1962 年 11 月，获得西南财经大学博士学位。

（三）基金托管部门的设置及员工情况

中国银行总行于 1998 年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，根据不断丰富和发展的托管对象和托管服务种类，中国银行于 2005 年 3 月 23 日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，下设覆盖销售、市场、运营、风险与合规管理、信息技术、行政管理等各层面的多个团队，现有员工 90 余人；另外，在上海市分行、深圳市分行设有托管业务团队。

（四）证券投资基金托管情况

截止 2008 年 12 月末，中国银行已托管景宏、同盛、华夏行业精选、同智优势成长、易方达平稳增长、易方达策略成长、易方达策略成长二号、易方达积极成长、易方达货币、易方达月月收益、易方达深证 100 交易型开放式指数、嘉实服务增值、嘉实成长收益、嘉实理财通系列（含嘉实稳健、嘉实增长、嘉实债券）、嘉实货币、嘉实沪深 300 指数、嘉实超短债、嘉实主题精选、银华优势企业、银华优质增长股票型、海富通收益增长、海富通货币、海富通股票、海富通精选 2 号、万家 180 指数、金鹰成份股优选、华夏回报、华夏回报二号、华夏大盘精选、景顺长城景系列（含景顺长城动力平衡、景顺长城货币、景顺长城优选股票）、景顺长城鼎益股票型、泰信天天收益、泰信优质生活、招商先锋、大成蓝筹稳健、大成财富管理 2020、大成优选、泰达荷银行业精选、国泰沪深 300 指数、国泰金鹏蓝筹价值、友邦华泰盛世中国、友邦华泰积极成长、南方高增长、工银瑞信核心价值股票型、华宝兴业动力组合、华宝兴业先进成长股票型、国海富兰克林潜力组合、银河竞争优势成长、国投瑞银稳定增利债券型、嘉实研究精选股票、长盛创新先锋灵活配置、国泰金鹿保本二期、易方达中小盘股票型、友邦华泰价值、工银瑞信大盘蓝筹、银华领先策略股票型、泰达荷银集利债券型基金、华宝兴业大盘精选股票型基金、华夏策略精选灵活配置混合型基金、富兰克林国海强化收益债券型等 64 只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币市场型、指数型、

行业型、创新型等多种类型的基金和理财品种，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（五）托管业务的内部控制制度

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权，并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自 1998 年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求，以控制和防范基金托管业务风险为主线，制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度，将风险控制落实到每个工作环节；在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙，安装了录音监听系统，以保证基金信息的安全；建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度，保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全；制定了内部信息管理制度，严格遵循基金信息披露规定和要求，及时准确地披露相关信息。

托管及投资者服务部总经理对托管业务的风险控制负第一责任。部门内部设有专门的风险控制小组，作为部内风险管理与内部控制的审议和决策机构，负责审议决定托管及投资者服务部风险管理战略、基本原则、风险管理目标和重大政策措施，检查和监督风险管理战略、方针和政策的执行情况。针对托管业务的特点，托管及投资者服务部内部设立高级合规官和风险与合规管理团队，具体开展部门内部内控及风险管理的相关工作。

最近一年内，中国银行的基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

（六）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同的相关规定，托管人就基金的投资范围、投资组合比例、投资限制、基金管理人报酬和基金托管人托管费的计提比例和支付方法、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配等事项，对基金管理人进行业务监督、复核。基金托管人在履行上述职责过程中，如发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

四、 相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1、直销机构：华宝兴业基金管理有限公司

住所：上海市世纪大道 88 号金茂大厦 48 层

办公地址：上海市世纪大道 88 号金茂大厦 48 层

法定代表人：郑安国

直销中心电话：021-38505888-301 或 302、38505731、38505732

直销中心传真：021-50499663、50499667、50988055

网址：www.fsfund.com

2、代销机构

(1) 中国银行股份有限公司

住所：北京市复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼

法定代表人：肖钢

客户服务统一咨询电话：95566

网址：www.boc.cn

(2) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：郭树清

客户服务统一咨询电话：95533

银行网址：www.ccb.com

(3) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客户服务热线：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

(4) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区正义路 4 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

联系电话：010-58351666

传真：010-83914283

联系人：吴杰

公司网址: www.cmbc.com.cn

客户服务电话: 95568

(5) 交通银行股份有限公司

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人: 蒋超良

电话: (021) 58781234

传真: (021) 58408483

联系人: 曹榕

客户服务电话: 95559

网址: www.bankcomm.com

(6) 招商银行股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址: 深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人: 秦晓

联系人: 万丽

电话: 0755-83195915

客服电话: 95555

公司网站: www.cmbchina.com

(7) 中国农业银行

注册地址: 北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址: 北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人: 项俊波

客户服务电话: 95599

网址: www.95599.cn

(8) 中信银行股份有限公司

注册地址: 北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人: 孔丹

客服电话: 95558

公司网址: bank.ecitic.com

(9) 深圳发展银行股份有限公司

地址: 深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人: 法兰克纽曼 (Frank N. Newman)

联系人: 周勤

联系电话：0755-82088888

传真电话：0755-82080714

客户服务电话：95501

公司网址：www.sdb.com.cn

(10) 联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 25、24、10 层

办公地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 25、24、10 层

法定代表人：马昭明

客服电话：400-8888-555

电话：0755-82493561

联系人：盛宗凌

公司网址：www.lhzq.com

(11) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦

法定代表人：祝幼一

电话：021-38676161

传真：021-38676161

联系人：芮敏祺

客户服务热线：400-8888-666

公司网址：www.gtja.com

(12) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：肖时庆

联系人：李洋

电话：010-66568047

客户服务电话：4008-888-888

网站：www.chinastock.com.cn

(13) 中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：张佑君

电话：400-8888-108(免长途费)

联系人：权唐

公司网址：www.csc108.com

(14) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

办公地址：广东广州天河北路大都会广场 18、19、36、38、41 和 42 楼

法定代表人：王志伟

联系人：肖中梅

电话：020-87555888

传真：020-87555305

客户服务电话：95575 或致电各地营业网点

公司网站： www.gf.com.cn

(15) 长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客户服务热线：4008-888-999 或 027-85808318

联系人：李良

电话：021-63219781

传真：021-51062920

长江证券长网网址：www.95579.com

(16) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海淮海中路 98 号

办公地址：上海淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

服务热线：95553、400-8888-001 或拨打各城市营业网点咨询电话

联系人：李笑鸣

公司网址：www.htsec.com

(17) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 39—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 39—45 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943167

联系人：黄健

客户服务热线：4008881111、0755-26951111

公司网址：www.newone.com.cn

(18) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

电话：021-54033888

传真：021-54035333

客服电话：021-962505

网址：www.sw2000.com.cn 或 www.sywg.com.cn

(19) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 99 号标力大厦

办公地址：上海市陆家嘴东路 166 号中保大厦 19 楼

法定代表人：兰荣

电话：021-68419974

联系人：杨盛芳

客户服务热线：400888123

公司网站：www.xyzq.com.cn

(20) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：唐双宁

电话：021-22169081

传真：021-22169134

联系人：刘晨

客户服务热线：10108998、400888788

公司网址：www.ebscn.com

(21) 平安证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区八卦岭三路平安大厦 3 楼

办公地址:深圳市福田区八卦岭三路平安大厦 3 楼

法定代表人:叶黎成

联系人:袁月

电话:0755-22627802

客服电话:4008816168

公司网址:www.pa18.com

(22) 东方证券股份有限公司

注册地址:上海市中山南路 318 号新源广场 2 号楼 21F-29F

法定代表人:王益民

联系人:吴宇

电话:021-63325888

传真:021-63327888

客户服务热线:95503

公司网站:www.dfzq.com.cn

(23) 国信证券股份有限公司

注册地址:深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦

法定代表人:何如

联系人:林建闽

电话:0755-82130833

传真:0755-82133302

客户服务热线:800-810-8868

国信证券网站:www.guosen.com.cn

(24) 长城证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人:黄耀华

联系人:匡婷

电话:0755-83516289

传真:0755-83516199

客户服务热线：0755-33680000、400 6666 888

长城证券网站：www.cc168.com.cn

(25) 东吴证券有限责任公司

注册地址：江苏省苏州市石路爱河桥 26 号

办公地址：江苏省苏州市石路爱河桥 26 号

法定代表人：吴永敏

联系人：方晓丹

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

客户服务电话：0512-96288

公司网站：www.dwzq.com.cn

(26) 中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市湖贝路 1030 号海龙王大厦

办公地址：北京朝阳区新源南路 6 号京城大厦

法定代表人：王东明

电话：010-84864818

传真：010-84865560

联系人：陈忠

公司网址：www.ecitic.com

(27) 中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507—1510 室）

办公地址：青岛市东海西路 28 号

法定代表人：史洁民

联系电话：0532-85022026

传真：0532-85022026

联系人：丁韶燕

公司网址：www.zxwt.com.cn

中信万通证券客户咨询电话：0532-96577

(28) 华泰证券股份有限公司

住所：南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：025-84457777-950、248

传真：025-84579763

联系人：李金龙、张小波

客户服务热线：025-84579897

公司网址：WWW.HTSC.COM.CN

(29) 恒泰证券有限责任公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

法定代表人：刘汝军

电话：0471-4913998

传真：0471-4930707

联系人：常向东

客户服务电话：0471-4961259

网址：www.cnht.com.cn

(30) 中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

法定代表人：唐新宇

咨询电话：4006208888 或各地营业网点咨询电话

业务传真：021-50372474

网址：www.bocichina.com.cn

(31) 中信金通证券有限责任公司

住所：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

法定代表人：刘军

客户服务电话：96598

联系人：王勤

电话：0571-85783715

公司网址：www.bigsun.com.cn

(32) 渤海证券股份有限公司

住所：天津市经济技术开发区第一大街 29 号

办公地址：天津市河西区宾水道 3 号

法定代表人：张志军

电话：022-28451861、022-28451650

传真：022-28451892

联系人：王兆权、姜莹

网址：www.ewww.com.cn

客户服务电话：400-651-5988

(33) 中国建银投资证券有限责任公司

住所：深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心 48-50 层

法定代表人：杨小阳

客服电话：400-600-8008

网址：www.cjis.cn

(34) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 层，28 层 A02 单元

法定代表人：牛冠兴

联系电话：0755-23982995

传真：0755-23982898

联系人：张林

客服电话：4008-001-001

公司网址：www.essences.com.cn

(35) 中国国际金融有限公司

住所：北京建国门外大街 1 号 国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：李剑阁

(36) 华宝证券经纪有限责任公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 23 层

法定代表人：陈林

客户服务电话：4008209898、021-38929908

公司网站：<http://www.cnhbstock.com/>

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

(二) 注册登记机构：华宝兴业基金管理有限公司

注册地址：上海市世纪大道 88 号金茂大厦 48 层

办公地址：上海市世纪大道 88 号金茂大厦 48 层

电话：021—38505888

传真：021—38505777

联系人：宋三江

(三) 律师事务所和经办律师

名称：上海市海华永泰律师事务所

住所：上海市东方路 69 号裕景国际商务广场 A 楼 7 层

办公地址：上海市东方路 69 号裕景国际商务广场 A 楼 7 层

负责人：颜学海

联系电话：(021) 58773177

传真：(021) 58773268

联系人：冯加庆

经办律师：冯加庆、李楠

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

名称：安永华明会计师事务所

住所：上海市长乐路 989 号世纪商贸广场 45 楼

办公地址：上海市长乐路 989 号世纪商贸广场 45 楼

法定代表人：沈钰文

联系电话：(021) 24052000

传真：(021) 54075507

联系人：徐艳

经办注册会计师：徐艳、蒋燕华

五、 基金名称

华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

六、 基金类型

契约型开放式基金

七、 基金的投资

(一) 本基金投资目标、范围、策略、业绩比较基准和风险收益特征

1、投资目标

在控制风险的前提下，争取基金净值中长期增长超越业绩比较基准。

2、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资股票指数期货等其他品种，基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。

3、投资策略

(1) 资产配置策略

本基金采取积极的资产配置策略，通过宏观策略研究，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类资产配置比例。本基金的股票投资比例为基金资产净值的 60%-95%，其中投资于大盘股市值占非现金资产的比例不低于 80%，权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%，资产支持证券比例为基金资产净值的 0%-20%，债券及现金投资比例为基金资产净值的 5%-40%（其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于 5%）。本基金的大盘股指沪深 A 股按照流通市值从大至小排名在前 1/3 的股票。

(2) 股票投资策略

本基金将深入研究大盘股基本面和长期发展前景，注重价值挖掘，精选个股。

1) 定量与定性相结合的个股精选策略

本基金的股票池主要包括大盘股。

在股票池中先用 7 个指标进行定量分析，这 7 个定量指标分别为：

成长指标：--预测未来两年 EPS 复合增长率

价值指标：--预测 P/E --预测 P/B

 --预测 P/CF --预测 P/S

盈利指标：--过去三年平均 ROE

 --过去三年平均 ROIC

筛选出排名靠前的股票形成初选股票池。

对初选股票池中的股票，进行案头研究和实地调研，深入研究企业的基本面和长期发展前景，

精选符合以下一条或数条定性判断标准的股票，形成备选股票池：

- 明显的规模经济和范围经济；
- 行业地位突出，强大的核心竞争力；
- 良好的管理能力和长远规划；
- 盈利能力强且注重股东回报和投资者关系；
- 公司治理完善、信息披露规范等。

2) 行业调整策略

通过对宏观经济、行业经济的把握以及对行业运行周期的认识，调整股票资产在不同行业的投资比例。

(3) 债券投资策略

本基金将通过大资产配置、分类资产配置和个券选择三个层次自上而下进行债券投资管理，以追求稳定收益和充分流动性的投资目标。

大资产配置主要是通过对宏观经济趋势、金融货币政策和利率趋势的判断对货币资产和债券类资产进行选择配置，同时也在银行间市场、交易所债券市场进行选择配置。

分类资产配置主要通过分析债券市场变化、投资人行为、品种间相对价值变化、债券供求关系变化和信用分析进行分类品种配置。可选择配置的品种范围有国债、金融债、企业债、央票、短期融资券。

品种选择上，主要通过利率趋势分析、投资人偏好分析、对收益率曲线形态变化的预期、信用评估、市场收益率定价、流动性分析，筛选出流动性良好，成交活跃、符合目标久期、到期收益率有优势且信用风险较低的券种。

主要采用的投资策略包括：

1) 久期灵活管理：在对宏观经济趋势、金融货币政策和利率趋势的判断基础上，确定债券组合久期目标范围，在可接受范围内可以按照市场实际变化灵活管理久期长短，以获取市场超额收益。

2) 曲线合理定价：按照市场各品种实际成交情况，得出合理收益率曲线，使用该曲线对备选品种进行合理定价，确定其公允价格，在此基础上筛选出价格低于其合理价值的品种。

3) 曲线下滑策略：对收益率曲线形态进行分析，并预测其未来形态变化，选择收益率曲线段上斜率最高区间进行下滑操作，买入曲线上端品种，等待其剩余年期缩短而自然形成收益率下滑，从而得到超额下滑利润。

(4) 其他品种投资策略

本基金将根据市场的实际情况及基金的申购赎回状况，将部分资产投资于中国证监会批准的允

许基金投资的其他金融工具，包括但不限于可转换债券、央行票据，捕捉市场机会，提高基金资产的使用效率。央行票据的投资策略见债券投资策略，可转换债券采用自上而下的两层次配置策略，在对宏观经济、行业分析的基础上，选择有成长性、前景看好的行业进行配置。最后落实到个股分析、转债具体条款分析、股性、债性分析上。利用转债的债性规避股市系统性风险和个股风险、追求投资组合的安全和稳定收益，并利用其股性在股市上涨中分享到行业和公司成长带来的收益。

另外，本基金具备投资权证的条件。本基金在权证投资中将权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

4、业绩比较基准

本基金股票投资的业绩比较基准为沪深 300 指数，债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。整体业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

沪深 300 指数是第一个覆盖了沪深两市的交易所权威指数，具有市值覆盖率高、行业代表性强、流动性好等特点。

当市场出现更合适、更权威的比较基准时，经基金托管人同意，本基金管理人履行适当程序后，可选用新的比较基准，并将及时公告。

5、风险收益特征

本基金属于证券投资基金中的较高风险、较高收益的品种。

(二) 投资程序

1、投资决策委员会负责投资决策

投资决策委员会定期和不定期召开会议，负责就基金重大战略和资产配置做出决策。

2、金融工程部负责跟踪数量分析模型

金融工程部实时跟踪数量分析模型，定期将股票排名结果提交给研究部和基金经理。

3、研究部负责投资研究和分析

宏观研究人员通过研究其他证券公司和基金管理公司的报告，通过走访政府决策部门和研究部门，研究经济形势、经济政策（货币政策、财政政策、区域政策、产业政策等）、重大技术发明等，撰写宏观研究报告，就基金的股票、债券、现金比例提出建议。

行业研究人员根据金融工程部定期提交的股票排名，以排名靠前的股票为主要研究对象，考察上市公司的基本面和长期发展前景，预测上市公司未来 2—3 年的经营情况，选择重点上市公司进

行调研，撰写行业和子行业研究报告及上市公司调研报告，对个股买卖提出具体建议。

4、基金经理小组负责投资执行

基金经理小组根据宏观经济和行业发展，结合量化分析等工具对股市做出判断，提出投资组合的资产配置比例建议，同时结合数量分析模型的股票排序和研究员的报告，形成投资计划提交投资决策委员会，并根据投资决策委员会的决策，具体实施投资计划。

经投资决策委员会和总经理审核投资组合方案后，基金经理向交易部下达具体的投资指令，交易员根据投资决定书执行指令。

5、绩效评估

主要包括四项核心功能：风格检验、风险评估、投资绩效的风险调整和业绩贡献，由绩效评估人员利用相关工具评估。

6、内部控制

内部控制委员会、督察长、副总经理、内控审计风险管理部负责内控制度的制定，并检查执行情况。

（三）投资限制与禁止行为

1、组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

- (1)本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (2)本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (3)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (4)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- (5)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- (6) 本基金股票、权证、债券、现金的投资比例范围为：股票占基金资产净值的 60%—95%，权证占 0%—3%，资产支持证券占 0%-20%，债券及现金占 5%-40%（其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于 5%）；
- (7)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (8)本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (9)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (10)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各

类资产支持证券合计规模的 10%；

(11)本基金投资的资产支持证券必须在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易；

(12)本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级。本基金应投资于信用级别评级为 **BBB** 以上（含 **BBB**）的资产支持证券，在持有期间如果其信用等级下降、不再符合投资标准，本基金应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(13)基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(14)本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(15)保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

(16)法律法规或监管部门取消上述限制，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。对于因基金规模短期内快速增长而导致证券投资比例低于基金合同约定的，基金管理人可将调整时限从十个交易日延长到三个月。基金规模快速增长主要是指基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产规模在 10 个交易日内增加 10 亿元以上的情形。基金发生上述需延长建仓期限情形的，基金管理人应同基金托管人协商一致并及时向中国证监会基金监管部书面报告，说明上述情况出现的原因及解决方案。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

2、禁止行为

本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是法律法规另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

(四) 基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

(五) 基金管理人代表基金行使股东权利的原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金财产的安全与增值；
- 3、独立行使股东权利，保护基金投资人的利益；
- 4、基金管理人按照有关规定代表基金出席上市公司股东大会，行使股东权利，履行股东义务。

八、 基金的投资组合报告

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 | 277,884,249.07 | 66.79 |
| | 其中：股票 | 277,884,249.07 | 66.79 |
| 2 | 固定收益投资 | 20,366,000.00 | 4.90 |
| | 其中：债券 | 20,366,000.00 | 4.90 |
| | 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 | 114,586,975.40 | 27.54 |
| 6 | 其他资产 | 3,215,098.18 | 0.77 |
| 7 | 合计 | 416,052,322.65 | 100.00 |

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 | - | - |
| B | 采掘业 | 19,152,900.00 | 4.75 |
| C | 制造业 | 122,879,090.57 | 30.47 |
| C0 | 食品、饮料 | 10,899,125.38 | 2.70 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | 1,224,000.00 | 0.30 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 12,938,558.45 | 3.21 |

| | | | |
|-----|----------------|----------------|-------|
| C5 | 电子 | 23,653,800.74 | 5.87 |
| C6 | 金属、非金属 | 34,623,300.00 | 8.59 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 24,191,406.00 | 6.00 |
| C8 | 医药、生物制品 | 15,348,900.00 | 3.81 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 19,287,300.00 | 4.78 |
| F | 交通运输、仓储业 | 10,704,000.00 | 2.65 |
| G | 信息技术业 | 11,446,200.00 | 2.84 |
| H | 批发和零售贸易 | 16,449,858.50 | 4.08 |
| I | 金融、保险业 | 57,113,300.00 | 14.16 |
| J | 房地产业 | 15,157,600.00 | 3.76 |
| K | 社会服务业 | - | - |
| L | 传播与文化产业 | 5,694,000.00 | 1.41 |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 277,884,249.07 | 68.92 |

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 | 000016 | 深康佳A | 4,080,078 | 19,706,776.74 | 4.89 |
| 2 | 601166 | 兴业银行 | 760,000 | 17,464,800.00 | 4.33 |
| 3 | 600030 | 中信证券 | 560,000 | 14,263,200.00 | 3.54 |
| 4 | 600000 | 浦发银行 | 610,000 | 13,371,200.00 | 3.32 |
| 5 | 000877 | 天山股份 | 750,000 | 10,845,000.00 | 2.69 |
| 6 | 601006 | 大秦铁路 | 1,200,000 | 10,704,000.00 | 2.65 |
| 7 | 000651 | 格力电器 | 410,600 | 10,679,706.00 | 2.65 |
| 8 | 600050 | 中国联通 | 1,800,000 | 10,386,000.00 | 2.58 |
| 9 | 601666 | 平煤股份 | 430,000 | 8,496,800.00 | 2.11 |
| 10 | 600266 | 北京城建 | 590,000 | 7,770,300.00 | 1.93 |

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | 20,366,000.00 | 5.05 |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 可转债 | - | - |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 20,366,000.00 | 5.05 |

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 | 0701016 | 07 央行票据 16 | 200,000 | 20,366,000.00 | 5.05 |
| 2 | - | - | - | - | - |
| 3 | - | - | - | - | - |
| 4 | - | - | - | - | - |
| 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。

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。

8、 投资组合报告附注

（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。

（2）本基金股票投资的主要对象是大盘股，基金管理人建立有基金股票备选库。本报告期内本基金处于六个月的建仓期。

（3） 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 70,830.73 |
| 5 | 应收申购款 | 2,985,731.45 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | 158,536.00 |
| 8 | 合计 | 3,215,098.18 |

（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） 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情况。

九、 基金的业绩

基金业绩截止日为 2009 年 3 月 31 日，所列数据未经审计。

1、净值增长率与同期比较基准收益率比较：

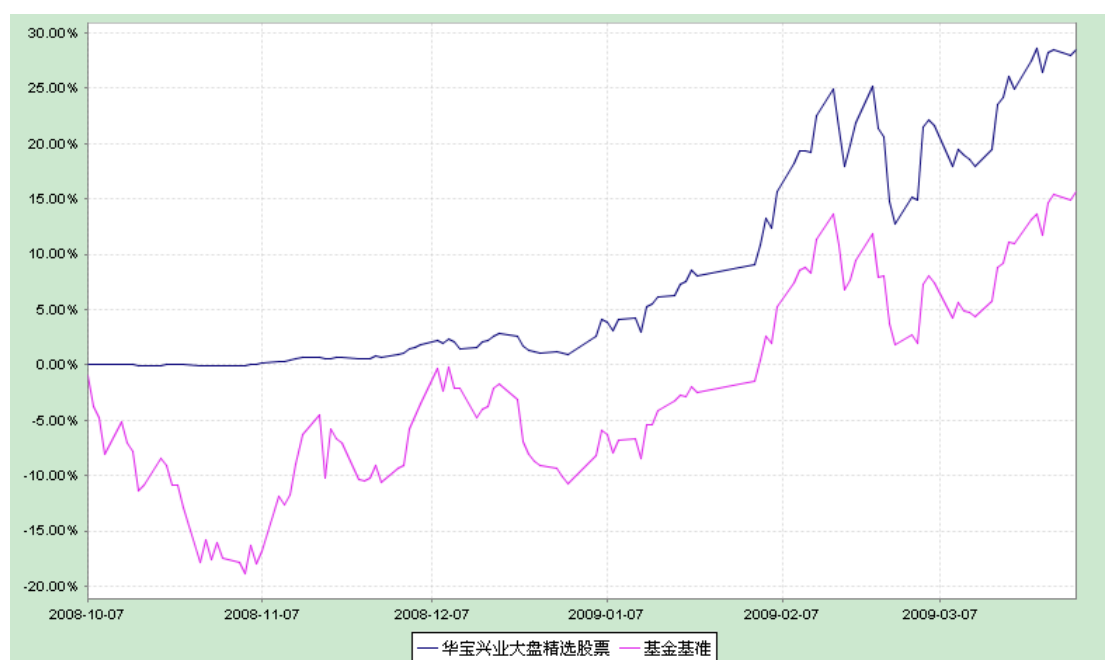
| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率标准差 ② | 业绩比较基准收益率 ③ | 业绩比较基准收益率标准差 ④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------------|------------|---------------|----------------|-------------------|--------|--------|
| 2008/10/7-2008/12/31 | 0.98% | 0.21% | -10.74% | 2.39% | 11.72% | -2.18% |
| 2009/1/1-2009/3/31 | 27.28% | 1.79% | 29.63% | 1.86% | -2.35% | -0.07% |
| 2008/10/7-2009/3/31 | 28.53% | 1.26% | 15.71% | 2.17% | 12.82 | -0.91% |

2、自基金合同生效以来基金累计份额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：

华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2008 年 10 月 7 日至 2009 年 3 月 31 日)



注：1、本基金基金合同生效于 2008 年 10 月 7 日，截止报告日本基金基金合同生效未满一年。

2、基金依法应自成立日期起 6 个月内达到基金合同约定的资产组合，本基金合同生效于 2008 年 10 月 7 日，本报告期处于建仓期。

十、 基金费用概览

(一) 与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

(1) 基金管理人的管理费；

(2) 基金托管人的托管费；

(3) 因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；

(4) 基金合同生效以后的信息披露费用；

(5) 基金份额持有人大会费用；

(6) 基金合同生效以后与本基金相关的会计师费和律师费；

(7) 基金的资金汇划费用；

(8) 按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

(2) 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

(3) 上述“1、基金费用的种类”中(3)到(8)项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

4、不列入基金费用的项目

本条第(一)款约定以外的其他费用，以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义

务导致的费用支出或基金财产的损失等不列入基金费用。

5、基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前3个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费

投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。本基金的申购费率表如下：

| 申购金额 | 申购费率 |
|-----------------|---------|
| 500万（含）以上 | 每笔1000元 |
| 大于等于200万，小于500万 | 0.5% |
| 大于等于100万，小于200万 | 1.0% |
| 大于等于50万，小于100万 | 1.2% |
| 50万以下 | 1.5% |

本基金的申购费用由申购人承担，主要用于市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

本基金将采用外扣法计算申购费用及申购份额。其中，

净申购金额 = 申购金额 / [1 + 申购费率]

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

申购费用、净申购金额的计算按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。申购份额的计算结果保留小数点后两位，两位以后舍去，舍去部分所代表的资产归基金财产所有。

2、赎回费

赎回费随基金持有时间的增加而递减，费率如下：

| 持有时间 | 费率 |
|------------|------|
| 两年以内（含两年） | 0.5% |
| 两年—三年（含三年） | 0.3% |
| 三年以上 | 0% |

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中25%的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

赎回总额=赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

净赎回金额=赎回总额－赎回费用

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额，净赎回金额为赎回金额扣除赎回费用的金额，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

1、转换费

本基金与公司管理的其他基金转换，转换费用由二部分组成：转出基金赎回费和转入基金与转出基金的申购补差费。

赎回费：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。其中 25%归转出基金基金财产，其余作为注册登记费和相关的手续费。

申购补差费：按照转入基金与转出基金的申购费率的差额收取补差费。转出基金金额所对应的转出基金申购费率低于转入基金的申购费率的，补差费率为转入基金和转出基金的申购费率差额；转出基金金额所对应的转出基金申购费率高于转入基金的申购费率的，补差费为零。

4、基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施 2 个工作日前在至少一种中国证监会指定媒体上刊登公告。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，也可针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，经相关销售机构同意，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

(三)其他费用

本基金其他费用根据相关法律法规执行。

十三、《招募说明书》更新部分的说明

根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)及其他有关规定,华宝兴业基金管理公司对《华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金招募说明书》作如下更新:

1、“二、释义”部分更新了基金合同生效日。

- 2、“三、基金管理人”部分“(二) 主要人员情况”更新了董事、经理及其他高级管理人员、本基金基金经理、投资决策委员会成员的信息。
- 3、“四、基金托管人”部分更新了托管人的情况和信息。
- 4、“五、相关服务机构”部分更新了代销机构的相关信息，更新了联合证券、中信建投证券、广发证券、海通证券、招商证券、光大证券、东方证券等信息，增加了工商银行、招商银行、农业银行、中信银行、深发展银行、中信金通证券、渤海证券、中投证券、安信证券、中金公司和华宝证券的信息。
- 5、更新了“六、基金的募集”一章。
- 6、更新了“九、与基金管理人管理的其他基金转换”一章。
- 7、“十、基金的投资”部分增加了截至 2009 年 3 月 31 日的基金的投资组合报告。
- 8、“增加了“十一、基金的业绩”一章,载明了截至 2009 年 3 月 31 日的基金业绩数据。
- 9、“十四、基金收益与分配”一章中,“(二) 收益分配原则”部分的增加了“(2) 分红方式的设置与变更”的内容。
- 11、修改了“十五、基金费用”中“(二) 与基金销售有关的费用”部分。
- 12、“二十三、对基金份额持有人的服务”一章中,更新了本基金定期定额投资计划和基金转换的内容。
- 13、“二十四、其他应披露事项”部分,对本报告期内的相关公告作了信息披露。

上述内容仅为摘要,须与本《招募说明书》后面所载之详细资料一并阅读。

华宝兴业基金管理有限公司

2009 年 5 月 22 日