华宝兴业多策略增长开放式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,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11月11日, 有关财务数据和净值表现截止日为2009 年9月30日,数据未经审计。

一、《基金合同》生效日期

本基金自2004年3月31日到2004年4月30日向个人投资者和机构投资者同时发售,《基金合同》于2004年5月11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

总经理: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

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、董事会成员

郑安国先生,董事长,博士、高级经济师。曾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、总裁。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。

裴长江先生,董事,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经理。

Arkadiusz Marek CIESLA先生,董事,工商管理硕士。曾任法国兴业银行审计员、法国兴业资产管理有限公司欧洲和中东地区总监、法国兴业资产管理有限公司(捷克共和国)董事长兼总裁。现任华宝兴业基金管理有限公司总经理高级顾问。

张群先生,独立董事,博士、教授、博导。曾任北京科技大学金属材料系讲师、北京科技大学管理科学系讲师。现任北京科技大学经济管理学院教授、院长。

罗飞先生,独立董事,博士、教授、博导。曾任中南财经政法大学会计系讲师、会计系西方会计研究室主任、会计系副主任、会计学院院长。现任中南财经政法大学经济与会计监管中心主任。

江岩女士,独立董事,法学学士、工商管理硕士。曾任中国政法大学教师、深圳市轻工集团公司法律秘书、南方证券股份有限公司深圳总部总经理、国际业务总部总经理助理、总经理。现任北京竞天公诚律师事务所律师。

2、监事会成员

陆云飞(Denis LEFRANC)先生,监事,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。

王晓薇女士,监事,本科。曾任宝钢国际贸易有限公司财务部业务经理、宝钢美洲贸易有限公司财务经理。现任华宝信托投资有限责任公司副总经理。

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。

3、总经理及其他高级管理人员

裴长江先生,总经理,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经理。

任志强先生,副总经理,硕士。曾任南方证券有限公司上海分公司研究部总经理助理、南方证券研究所综合管理部副经理,华宝信托投资责任有限公司发展研究中心总经理兼投资管理部总经理、华宝信托投资责任有限公司总裁助理兼董事会秘书,华宝证券经纪有限公司董事、副总经理。现任华宝兴业基金管理有限公司副总经理兼投资总监、华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理。

黄小薏(HUANG Xiaoyi Helen)女士,副总经理,硕士。曾任加拿大明道银行证券公司金融分析师,Acthop投资公司财务总监。现任华宝兴业基金管理有限公司副总经理、营运总监兼董事会秘书。

刘月华先生,督察长,硕士。曾在冶金工业部、国家冶金工业局、中国证券业协会等单位工作。现任华宝兴业基金管理有限公司督察长。

4、本基金基金经理

牟旭东先生,经济学硕士,曾在南方证券有限公司担任行业研究部副经理,历任华宝兴业基金管理有限公司高级分析师、研究部副总经理、研究部总经理。2003年1月加入本公司。2007年10月开始担任多策略增长基金基金经理。2009年2月开始担任增强收益债券基金基金经理。

多策略增长基金的历任基金经理为童国林先生,任职时间为2004年5月至2006年4月。余荣权先生,任职时间为2006年4月至2007年4月。黄小坚先生,任职时间为2006年9月至2007年10月。

5、投资决策委员会成员

任志强先生,副总经理、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。

郭鹏飞先生,研究部总经理。

冯刚先生,国内投资部总经理、收益增长基金和大盘精选基金基金经理。

Tan Weisi先生,固定收益部总经理,宝康债券基金基金经理。

牟旭东先生,多策略增长基金基金经理,增强收益债券基金基金经理。

(三)基金管理人内部控制制度

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,维护内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;公司自有资产、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、市场营销等相关部门,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地修改或完善。

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、建立完整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。

三、基金托管人

一、基金托管人情况

(一)基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)

住所: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

成立时间:2004年09月17日

组织形式:股份有限公司

注册资本:贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号

联系人:尹东

联系电话:(010)6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史,其前身"中国人民建设银行"于1954年成立,1996年易名为"中国建设银行"。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代号:HK0939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后建设银行的已发行股份总数为:233,689,084,000股(包括224,689,084,000股H股及9,000,000,000股A股)。

2009年上半年,中国建设银行实现净利润558.41亿元,同比下降4.86%,每股盈利为0.24元(半年),同比减少0.01 元,盈利水平符合预期;年化平均资产回报率、年化平均股东权益回报率分别为1.34%和22.54%,较上年全年分别提高0.03和1.86个百分点,整体盈利趋势向好;总资产达到91,101.71 亿元,较上年末增长20.58%;资产质量稳步上升,不良贷款额和不良贷款率实现双降,信贷资产质量持续改善,不良贷款率为1.71%,较上年末下降0.5 个百分点;拨备水平充分,拨备覆盖率为150.51%,较上年末提升18.93个百分点。

中国建设银行在中国内地设有1.4万余个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约设有分行,在伦敦设有全资子银行、在悉尼设有代表处。中国建设银行在香港拥有建行亚洲和建银国际两家全资子公司。全行已安装运行自动柜员机(ATM)31,896台,居全球银行业首位。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可,在2009 年上半年共获得40 多个国内外奖项。中国建设银行在英国《银行家》杂志公布的"全球金融品牌500强"、"全球银行1000强"中分列第9位和第12位,被《亚洲货币》杂志评为2009年度"中国最佳银行",被《欧洲货币》杂志评为2009年度"中国最佳银行",连续两年被香港《资本》杂志评为"中国杰出零售银行",荣获《亚洲银行家》杂志颁发的"中国风险管理成就奖","中国扶贫基金会颁发的"20年特别贡献奖"等奖项,被中国红十字基金会评为"最具责任感企业",连续两年荣获香港《财资》杂志"中国最佳境外客户境内托管银行奖"。

中国建设银行总行设投资托管服务部,下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室,现有员工130余人。2008年,中国建设银行一次性通过了根据美国注册会计师协会(AICPA)颁布的审计准则公告第70号(SAS70)进行的内 部控制审计,安永会计师事务为此提交了"业内最干净的无保留意见的报告",中国建设银行成为取得国际同业普遍认同并接受的SAS70国际专项认证的托管银行。

(二)主要人员情况

罗中涛,投资托管服务部总经理,曾就职于国家统计局、中国建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作,对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的管理经验。

李春信,投资托管服务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行人事教育部、计划部、筹资储蓄部、国际业务部,对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管服务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

(三)基金托管业务经营情况

截止到2009年9月30日,中国建设银行已托管华夏兴华封闭、华夏兴和封闭、嘉实泰和封闭、国泰金鑫封闭、国泰金盛封闭、融通通乾封闭、银河银丰封闭等7只封闭式证券投资基金,以及华夏成长混合、融通新蓝筹混合、博时价值增长混合、华宝兴业宝康配置混合、华宝兴业宝康消费品股票、华宝兴业宝康债券、博时裕富指数、长城久恒平衡混合、银华保本增值混合、华夏现金增利货币、华宝兴业多策略股票、国泰金马稳健混合、银华-道琼斯88指数、上投摩根中国优势混合、东方龙混合、博时主题行业股票(LOF)、华富竞争力优选混合、华宝兴业现金宝货币、上投摩根货币、华夏红利混合、博时稳定价值债券、银华价值优选股票、上投摩根阿尔法股票、中信红利股票、工银货币、长城消费增值股票、华安上证180ETF、上投摩根双息平衡混合、泰达荷银效率优选混合(LOF)、华夏中小板ETF、交银稳健配置混合、华宝兴业收益增长混合、华富货币、工银精选平衡混合、鹏华价值优势股票(LOF)、中信稳定双利债券、华安宏利股票、上投摩根成长先锋股票、博时价值增长贰号混合、海富通风格优势股票、银华富裕主题股票、华夏优势增长股票、信诚精萃成长股票、工银稳健成长股票、信达澳银领先增长股票、诺德价值优势股票、工银增强收益债券、国泰金鼎价值混合、富国天博创新股票、融通领先成长股票(LOF)、华宝兴业行业精选股票、工银红利股票、泰达荷银市值优选股票、长城品牌优选股票、交银蓝筹股票、华夏全球股票(QDII)、易方达增强回报债券、南方盛元红利股票、交银增利债券、工银添利债券、宝盈资源优选股票、华安稳定收益债券、兴业社会责任股票、华宝兴业海外中国股票(QDII)、海富通中国海外股票(QDII)、宝盈增强收益债券、鹏华丰收债券、博时特许价值股票、华富收益增强债券、信诚盛世蓝筹股票、东方策略成长股票、中欧新蓝筹混合、汇丰晋信2026周期混合、信达澳银精华配置混合、大成强化收益债券、交银环球精选股票(QDII)、长城稳健增利债券、华商盛世成长股票、信诚三得益债券、长盛积极配置债券、鹏华盛世创新股票(LOF)、华安核心股票、富国天丰强化债券、光大保德信增利收益债券、诺德灵活配置混合、东吴优信稳健债券、银华增强收益债券、东方稳健回报债券、华富策略精选混合、长城双动力股票、上投摩根中小盘股票、华商收益增强债券、泰达荷银品质生活股票、光大保德信均衡精选股票、银河行业优选股票、海富通领先成长股票、诺德增强收益债券、工银瑞信沪深300指数、信诚经典优债债券、国泰双利债券、民生加银品牌蓝筹混合、信达澳银稳定价值债券、中欧稳健收益债券、万家精选股票、浦银安盛精致生活混合、长盛同庆可分离交易股票、富国优化增强债券、长城景气行业龙头混合、天治趋势精选灵活配置混合、中欧价值发现股票、长信恒利优势股票、民生加银增强收益债券、国联安主题驱动股票、宝盈货币市场基金、博时策略灵活配置混合、信诚优胜精选股票、易方达沪深300指数、中银中证100指数增强、鹏华精选成长股票、金元比联价值增长股票、诺德成长优势股票、摩根士丹利华鑫领先优势、华宝兴业中证100指数、华安上证180ETF联接基金、农银汇理策略价值股票基金等125只开放式证券投资基金。

二、基金托管人的内部控制制度

(一)内部控制目标

作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

(二)内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管服务部专门设置了监督稽核处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

(三)内部控制制度及措施

投资托管服务部具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理严格实行复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

(一)监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的"托管业务综合系统——基金监督子系统",严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督,并定期编写基金投资运作监督报告,报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

(二)监督流程

1.每工作日按时通过基金监督子系统,对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控,发现投资比例超标等异常情况,向基金管理人发出书面通知,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,并及时报告中国证监会。

2.收到基金管理人的划款指令后,对涉及基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

3.根据基金投资运作监督情况,定期编写基金投资运作监督报告,对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价,报送中国证监会。

4.通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求管理人进行解释或举证,并及时报告中国证监会。

四、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构:

(1)直销柜台

本公司在上海开设直销柜台。

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

直销柜台电话:021-38505888-301或302

直销柜台传真:021-50499663、50499667、50988055

网址:www.fsfund.com

(2)直销e网金

投资者可以通过本公司网上交易直销e网金系统办理本基金的申购、赎回、转换等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上交易网址:www.fsfund.com。

2、代销机构:

(1)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

(2)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

客户服务电话:95566

网址:www.boc.cn

(3)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

客服电话:95555

联系人:万丽

电话:0755-83195915

公司网站:www.cmbchina.com

(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

客户服务电话:95568

公司网址:www.cmbc.com.cn

(5)中国工商银行股份有限公司

住所:北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人:姜建清

客户服务电话:95588

网址:www.icbc.com.cn

(6)中信银行股份有限公司

注册地址:北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人:孔丹

24小时客户服务热线:95558

网址:bank.ecitic.com

(7)中国农业银行股份有限公司

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)交通银行股份有限公司

住所: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

(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)上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号

法定代表人:吉晓辉

联系人:倪苏云

电话:021-61616153

传真:021-63604199

客户服务热线:95528

公司网址:www.spdb.com.cn

(11)华泰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:95513、400-8888-555

电话:0755-82492000

联系人:盛宗凌

公司网站:www.lhzq.com

(12)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

服务热线:400-8888-666

公司网站:www.gtja.com

(13)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:胡长生

联系人:李洋

电话:010-66568047

客户服务电话:4008-888-888

网站:www.chinastock.com.cn

(14)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:北京市东城区朝内大街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

(15)广发证券股份有限公司

注册地址:广东省广州天河北路大都会广场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:沈东燮

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:http://www.gf.com.cn

(16)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

(17)海通证券股份有限公司

注册地址: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

(18)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:4008888111、0755-26951111

公司网址:www.newone.com.cn

(19)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

服务热线:021-962505

联系人:王序微

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

(20)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:4008888123

公司网站:www.xyzq.com.cn

(21)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:北京市朝阳区新源南路6号京城大厦3层

法定代表人:王东明

电话:010-84588888

传真:010-84865560

联系人:陈忠

公司网址:www.ecitic.com

(22)国元证券股份有限公司

注册地址:合肥寿春路179号

办公地址:合肥寿春路179号

法定代表人:凤良志

电话:(0551)2634400

传真:(0551)2626941

联系人:程维

客户服务热线:4008888777(全国统一客户服务热线)

公司网址:www.gyzq.com.cn

(23)东吴证券有限责任公司

注册地址:苏州工业园区翠园路181号商旅大厦

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:0512-33396288

公司网站:www.dwzq.com.cn

(24)光大证券股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔15-16楼

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、4008888788

公司网址:www.ebscn.com

(25)平安证券有限责任公司

办公地址:深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼

法定代表人:叶黎成

联系人:袁月

电话:0755-22627802

客户服务热线:4008816168

网站:www.pa18.com

(26)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:021-95503

公司网站:www.dfzq.com.cn

(27)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

(28)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:0755-82130833-2181

传真:0755-82133302

客户服务热线:800-810-8868

国信证券网站:www.guosen.com.cn

(29)中信万通证券有限责任公司

注册地址:青岛市崂山区香港东路316号

办公地址:青岛市东海西路28号

法定代表人:史洁民

电话:0532-85022026

传真:0532-85022026

联系人:丁韶燕

客户咨询电话:0532-96577

公司网址:www.zxwt.com.cn

(30)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

(31)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

传真:021-50372474

(32)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号邮编010010

办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号邮编010010

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

(33)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

(34)渤海证券股份有限公司

注册地址:天津市开发区第一大街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

传真: (022)28451892

联系人:王兆权

客服电话:28455588

网址:www.bhzq.com

(35)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

(36)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

(37)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

(38)华宝证券有限责任公司

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/

(39)齐鲁证券有限公司

住所:济南市经十路128号

法定代表人:李玮

注册资本: 52.12亿元

公司网站:www.qlzq.com.cn

齐鲁证券有限公司客户服务电话:95538

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)基金注册登记机构: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:普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址:上海市浦东新区东昌路568号

办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人:杨绍信

联系电话:(021)61238888

传真: (021)61238800

联系人:陈兆欣

经办注册会计师:肖峰 陈玲

五、基金简介

基金名称:华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金

基金类型:契约型开放式基金

六、基金的投资

(一)投资目标

通过各风格板块间资产配置以及各板块内精选个股,在控制风险的前提下为持有人谋求最大回报。

(二)投资范围和对象

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,主要包括国内依法发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。

本基金的股票投资对象按流通市值和市净率分为四大股票风格板块:大盘价值、大盘成长、中小盘价值、中小盘成长。80%以上的股票资产投资于符合各风格板块精选个股标准的股票。

(三)投资理念

风格转换及个股精选策略能够有效控制风险,创造超额收益。

(四)投资策略

本基金看好中国经济的发展前景和证券市场存在的投资机会,注重资产在各风格板块间的配置,同时在各风格板块内部精选个股。

在正常的市场情况下,本基金的股票投资比例范围为基金资产净值的50%-95%;债券为0%-45%,现金或者到期日在一年内的政府债券比例在5%以上。

1、股票投资策略

(1)风格板块轮动策略

根据数量化辅助模型和公司内部研究支持以及基金经理自身判断,决定股票资产在各风格板块间的配置。当某一风格板块相对大市的超额收益率出现上升或者下降趋势并到达预设的临界点时,我们增加或者减少该板块的权重。

(2)风格板块的股票精选策略

针对各风格板块,有不同的板块内精选个股标准,定性指标与定量指标相结合,定性指标主要考察上市公司的治理结构、管理水平、竞争优势及行业特点等因素。

1)大盘价值板块:采用股息率、市盈率、市净率、市销率、市现率五个指标。股息率较高的股票得分较高,市盈率、市净率、市销率、市现率较低的股票得分也较高。

2)大盘成长板块:我们侧重于选取具有难以超越的竞争优势的个股。主要考虑公司是否具有优越的管理团队,具有长期发展策略;具有垄断优势;公司所处行业基本面已经好转,且已有融资计划的上市公司;所在行业中处于领先地位,或者占据绝对多数的市场份额;高收益增长率,高利润率;专利产品多,低成本的生产和/或分销能力。

3)中小盘价值:我们侧重选取内在价值被市场低估的个股。具体的评价指标是股票被低于其清算价值或其有形帐面价值出售;相对于其获益潜力或者重置成本来说,股票价格偏低;公司进行资产重组,股票价格大大低于市场估值;公司具有至少10-20%的增长率,财务状况良好,市盈率低于市场平均水平。

4)中小盘成长:我们倾向于选择业绩可能大幅增长、股本扩张能力强的上市公司的个股。主要考虑过往盈利持续增长或盈利增长潜力巨大;获取具有吸引力的净资产收益率(ROE)的能力;低于基金经理对未来三年预期盈利增长率的P/E指标;不断扩大的市场份额;良好的资产负债情况;股东及管理团队实力雄厚;较强的新产品开发能力。

2、债券投资策略

(1)本基金定位为股票型基金;在政策允许的情况下,本基金债券投资的下限为零;

(2)本基金债券投资的主要目的是为了回避特定时期股票投资可能存在的风险,同时能够获取债券投资的收益;

(3)本基金投资债券将采取稳健的投资策略。

3、权证投资策略

本基金具备投资权证的条件。我公司在权证投资中将对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。

(五)业绩比较基准

80%×复合指数+20%×上证国债指数。其中,

$$\text{复合指数}=\frac{\text{上证 180 流通市值}}{\text{成分指数总流通市值}}\times\text{上证 180 指数}+\frac{\text{深证 100 流通市值}}{\text{成分指数总流通市值}}\times\text{深证 100 指数}$$

成分指数总流通市值=上证180流通市值+深证100流通市值

(六)投资程序

1、公司研究部通过内部独立研究,并借鉴其他研究机构的研究成果,形成宏观、政策、投资策略、行业和上市公司等分析报告,为投资决策委员会和基金经理小组提供决策依据。

2、在投资决策委员会的指导下,基金经理小组综合对国内外宏观经济、货币环境、证券市场发展趋势等要素的分析判断,按照基金的合同规定,提出下一阶段本基金类属资产配置比例。

3、投资决策委员会定期和不定期召开会议,根据基金投资目标和对市场的判断决定本基金的总体投资策略,审核并批准基金经理小组提出的资产配置方案或重大投资决定。

4、基金经理小组根据投资决策委员会所做的决议,参考本公司研究部和其他研究机构的研究报告,选择具体的投资目标,构建投资组合。

5、设置独立的中央交易室,基金经理将投资指令下达给中央交易室,交易主管在复核投资指令合法合规的基础上,将指令分发给交易员执行。保证决策和执行权利的分离。

6、内部控制委员会根据市场变化对基金投资组合进行风险评估与监控,内控审计风险管理部对基金投资过程进行日常监督,出具风险报告。

7、基金经理小组将跟踪证券市场和上市公司的发展变化,结合基金申购和赎回导致的现金流量变化情况,以及组合风险和流动性的评估结果,对投资组合进行动态调整。

(七)基金的禁止行为

1、投资于其他基金;

2、以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券;

3、动用银行信贷资金从事证券买卖;

4、将基金财产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款;

5、从事证券信用交易;

6、以基金财产进行房地产投资;

7、从事有可能使基金承担无限责任的投资;

8、将基金财产投资于与基金托管人或基金管理人有利害关系的公司发行的证券;

9、违反证券交易业务规则,利用对敲、倒仓等行为来操纵和扰乱市场价格;

10、进行高位接盘、利益输送等损害基金份额持有人利益的行为;

11、通过股票投资取得对上市公司的控制权;

12、因基金投资股票而参加上市公司股东大会的、与上市公司董事会或其他持有5%以上投票权的股东恶意串通,致使股东大会表决结果侵犯社会公众股东的合法利益;

13、法律、法规及监管机关规定禁止从事的其他行为。

(八)基金投资组合比例限制

1、基金持有的股票、债券比例不低于基金资产总值的80%;

2、基金持有一家公司的股票,不得超过基金资产净值的10%;

3、基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%;

4、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

由于基金规模或市场的变化导致的投资组合超过上述约定的比例不在限制之内,但基金管理人应在10个交易日内进行调整,以达到标准。

5、我公司运用基金财产进行权证投资时,将严格参照证监会的有关规定,进行管理和控制:

(1)一只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千分之五;

(2)一只基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的百分之三;

(3)本公司管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的百分之十。

中国证监会另有规定的,不受上述(1)、(2)、(3)项规定的比例限制。

因证券市场波动、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不符合上述(2)、(3)项及基金合同或基金权证投资方案约定的投资比例的,本公司将在十个交易日内调整完毕。

(九)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,不参与所投资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、基金管理人按照国家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。

(十)基金的融资

基金可以按照国家的有关规定进行融资。

七、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至2009 年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

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	6,197,167,437.47	76.66
	其中:股票	6,197,167,437.47	76.66
2	固定收益投资	951,984,000.00	11.78
	其中:债券	951,984,000.00	11.78
	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	920,459,979.80	11.39
6	其他资产	14,094,184.31	0.17
7	合计	8,083,705,601.58	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	216,829,099.03	2.69
B	采掘业	560,871,063.28	6.97
C	制造业	2,786,502,218.43	34.63
C0	食品、饮料	173,784,117.69	2.16
C1	纺织、服装、皮毛	101,723,632.98	1.26
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	61,089,148.16	0.76
C4	石油、化学、塑胶、塑料	748,533,926.21	9.30
C5	电子	61,442,766.66	0.76
C6	金属、非金属	692,581,592.14	8.61
C7	机械、设备、仪表	498,471,411.67	6.20
C8	医药、生物制品	434,459,889.12	5.40
C99	其他制造业	14,415,733.80	0.18
D	电力、煤气及水的生产和供应业	275,960,321.74	3.43
E	建筑业	108,558,664.36	1.35
F	交通运输、仓储业	107,090,138.53	1.33
G	信息技术业	318,377,279.08	3.96
H	批发和零售贸易	488,645,842.25	6.07
I	金融、保险业	869,836,214.80	10.81
J	房地产业	286,148,630.22	3.56
K	社会服务业	28,976,812.06	0.36
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	149,371,153.69	1.86
	合计	6,197,167,437.47	77.02

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	600036	招商银行	31,766,736	469,512,358.08	5.84
2	002001	新和成	8,742,787	383,633,493.56	4.77
3	600900	长江电力	18,803,502	251,402,821.74	3.12
4	600588	用友软件	12,984,520	248,653,558.00	3.09
5	601166	兴业银行	6,071,230	205,146,861.70	2.55
6	600216	浙江医药	6,781,275	199,369,485.00	2.48
7	600309	烟台万华	11,194,786	192,998,110.64	2.40
8	600028	中国石化	16,263,938	183,782,499.40	2.28
9	601088	中国神华	5,488,600	166,633,896.00	2.07
10	600895	张江高科	10,632,149	138,324,258.49	1.72

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	801,435,000.00	9.96
3	金融债券	150,549,000.00	1.87
	其中:政策性金融债	150,549,000.00	1.87
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	951,984,000.00	11.83

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	0901039	09央行票据39	4,000,000	398,680,000.00	4.96
2	0901033	09央行票据33	1,500,000	149,520,000.00	1.86
3	0901035	09央行票据35	1,500,000	149,505,000.00	1.86
4	070401	07农发01	1,200,000	120,492,000.00	1.50
5	0801053	08央行票据53	1,000,000	103,730,000.00	1.29

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)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。

(2)本基金股票投资对象为上海和深圳两个交易所上市交易,并符合基金投资策略规定的各风格板块选股标准的股票,没有特定的备选股票库。

(下转D3版)

华宝兴业基金管理有限公司关于调整基金网上直销定期定额申购限额的公告

为了更好地为投资者提供服务,华宝兴业基金管理有限公司(以下简称"本公司")决定,自2009年12月28日起,将基金网上直销定期定额申购业务的单笔最高申购限额调整为50万元/笔(不含50万元),该定期定额申购限额适用于我司基金网上直销已开通定期定额申购业务的基金。

本公司可对上述限额进行调整,并依据相关法规的要求进行公告。

风险提示:

本公司承诺以诚实信用、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,也不保证最低收益。敬请投资人注意投资风险。

投资者在申请开立基金账户并进行网上交易时,应认真阅读有关网上交易服务协议和业务规则,了解基金投资和网上交易的固有风险。

特此公告。

华宝兴业管理有限公司

2009年12月25日