华宝兴业宝康系列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,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2011年7月15 日,有关财务数据和净值表现截止日为2011年6月30日,数据未经审计。

一、《基金合同》生效日期

本基金自2003年6月5日到2003年7月11日向个人投资者和机构投资者同时发售,《基金合同》于2003年7月15日生效。

二、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称: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
传真:021-38505777
联系人:熊鹏举

股权结构:中方股东华宝信托有限责任公司持有51%的股份,外方股东领先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、华宝信托有限责任公司董事长、华宝投资有限公司董事、总经理,中国太平洋保险(集团)股份有限公司董事。

Alain Jean Patrick DUBOIS先生,董事,硕士。曾任法国财政部预算办公室部门负责人、里昂信贷资本市场部从事研究开发工作、拉扎德兄弟银行部门经理、Arjil et Cie银行董事总经理、德国商业银行资深产品设计师、法国兴业银行资深产品设计师、领先资产管理有限公司业务发展部负责人。现任领先资产管理有限公司董事长。

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。

谢文杰先生,董事,金融学硕士。曾任汇丰银行外汇及期权交易员、法国兴业银行及投资银行初级市场及衍生品团队负责人、法国兴业银行及投资银行债务融资部亚洲区(除日本外)董事总经理兼结构化衍生品主任、法国兴业亚洲有限公司环球市场部中国区销售及交易部门主管、法国兴业亚洲有限公司领先资产管理中国区业务部门主管。现任华宝兴业基金管理有限公司副总经理。

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

张永光(Jackson CHEUNG)先生,监事,工商管理硕士。曾在法国兴业银行主管银团贷款、项目融资、固定收益、外汇交易、衍生产品及结构性融资等工作,法国兴业银行亚洲区债务融资及衍生产品业务部总管。现任法国兴业银行集团中国区总裁。

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。现任华宝兴业基金管理有限公司营运副总监。

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。

谢文杰先生,副总经理,金融学硕士。曾任汇丰银行外汇及期权交易员、法国兴业银行及投资银行初级市场及衍生品团队负责人、法国兴业银行及投资银行债务融资部亚洲区(除日本外)董事总经理兼结构化衍生品主任、法国兴业亚洲有限公司环球市场部中国区销售及交易部门主管、法国兴业亚洲有限公司领先资产管理中国区业务部门主管。现任华宝兴业基金管理有限公司副总经理。

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、华宝信托投资有限责任公司总裁助理兼董事会秘书,华宝证券有限公司董事、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、本系列基金基金经理

刘自强先生,硕士。曾在天同证券任研究员,中原证券任行业研究部副经理,上海融昌资产管理公司先后任研究员、研究总监。2006年5月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后担任高级分析师、研究部总经理助理、行业精选基金经理助理。2008年3月起担任华宝兴业动力组合股票型证券投资基金的基金经理。2010年6月起担任华宝兴业宝康消费品证券投资基金的基金经理。

胡戈游先生,硕士,拥有CFA资格。2005年2月加入华宝兴业基金管理有限公司,历任本公司金融工程部数量分析师、基金经理助理的职务。2009年5月至2010年6月担任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金的基金经理。2010年1月开始担任华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金经理,2011年2月起兼任华宝兴业宝康消费品证券投资基金的基金经理。

宝康消费品基金的历任基金经理为栾杰先生,任职时间为2003年7月至 2007年9月。王孝德先生,任职时间为2007年4月至2008年4月。闫旭女士,任职时间为2008年4月至2010年7月。

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。2010年1月开始担任宝康灵活配置基金基金经理。

郭鹏飞先生,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,先后担任研究部行业分析师、研究部副总经理。2009年3月起担任研究部总经理。2010年6月起担任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金的基金经理,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。

宝康灵活配置基金的历任基金经理为余荣权先生,任职时间为2003年7月至2004年5月。魏东先生,任职时间为2004年5月至2009年5月。胡戈游先生,任职时间为2009年5月至2010年6月。

Tan Weisi(覃微思)先生,博士,CFA。曾在平资产管理公司、塞克资产管理公司、汇丰银行、彭博公司、普天寿证券公司、美林公司从事固定收益研究、交易和投资工作。2009年2月起担任固定收益部总经理。2009年3月起担任宝康债券基金基金经理。

李栋梁先生,硕士,拥有CFA资格。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先后担任债券分析师、华宝兴业宝康债券基金经理助理,2011年6月28日起担任宝康债券基金基金经理。

宝康债券基金的历任基金经理为王旭巍先生,任职时间为2003年7月至2009年3月。

5、本公司投资决策委员会成员

任志强先生,副总经理、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。

牟旭东先生,国内投资部总经理、华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金、华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理。

郭鹏飞先生,华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理、华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金经理。

刘自强先生,华宝兴业宝康消费品证券投资基金基金经理、华宝兴业动力组合股票型证券投资基金基金经理。

王智慧先生,研究部总经理。

蒋宁女士,华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理。

6、本公司固定收益投资决策委员会成员

任志强先生,副总经理、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。

Tan Weisi先生,固定收益部总经理、华宝兴业宝康债券投资基金基金经理。

王智慧先生,研究部总经理。

华志贵先生,华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理、华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理、华宝兴业可转债债券型证券投资基金基金经理。

(三)基金管理人内部控制制度

1、风险管理体系

本系列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,维护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

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。

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
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(股票代码:939)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股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

截至2011 年3 月31 日,中国建设银行资产总额113,125.16 亿元,较上年末增加5,021.99 亿元,增长4.65%。2011年一季度,中国建设银行实现净利润472.33 亿元,较上年同期增长34.23%;年化平均资产回报率1.71%,年化加权平均净资产收益率26.19%;利息净收入716.30 亿元,较上年同期增长25.27%;净利差为2.58%,净利息收益率为2.69%,分别较上年同期提高0.28和0.30 个百分点;手续费及佣金净收入231.54 亿元,较上年同期增长37.29%。其中,结算、理财、电子银行、贷记卡及保理等重点产品快速增长,收入结构日趋合理。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行,在莫斯科设有代表处,设立了湖北桃江建信村镇银行、浙江苍南建信村镇银行、安徽繁昌建信村镇银行、浙江青田建信华侨村镇银行、浙江武义建信村镇银行、陕西安塞建信村镇银行、河北丰宁建信村镇银行、上海浦东建信村镇银行、苏州常熟建信村镇银行9家村镇银行,拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、中德住房储蓄银行等多家子公司。全行已安装运行自动柜员机(ATM)39,874台,拥有员工313,867人,为客户提供全面的金融服务。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可,2010年共获得100 多个国内外奖项。本集团在英国《银行家》杂志公布的"全球商业银行品牌十强"列第二 位,在"全球银行品牌500强"列第13位,并被评为2010年中国最佳银行;在美国《福布斯》杂志公布的"Interbrand2010年度最佳中国品牌价值排行榜"列第三 位,银行业第一位;被《亚洲金融》杂志评为2010 年度"中国最佳银行";连续三年被香港《资本》杂志评为"中国杰出零售银行";被中国红十字会总会授予"中国红十字杰出奉献奖章"。

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、团队,现有员工130余人。自2008年以来中国建设银行托管业务持续通过SAS70审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

(二)主要人员情况

杨新丰,投资托管服务部副总经理(主持工作),曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部,长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作,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

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持"以客户为中心"的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2011年6月30日,中国建设银行已托管195只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。2010年初,中国建设银行被总部设于英国伦敦的《全球托管人》杂志评为2009年度"国内最佳托管银行"(Domestic Top Rated),并连续第三年被香港《财资》杂志评为"中国最佳次托管银行"。

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,对涉及各基金的投资范围、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,电话或书面要求基金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:021-38505731、38505732、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认/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
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
客户服务电话:95533
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)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

(4)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

(5)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:胡怀邦
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:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:傅育宁
联系人:邓炯鹏
联系电话:0755-83198888
公司网址: www.cmbchina.com
客户服务电话: 95555

(7)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:010-57092615
传真:010-57092611
联系人:董云巍
客户服务电话:95568
公司网址:www.cmbc.com.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
24小时客户服务热线:95558
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:肖遂宁
联系人:张青
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:021-61618888
传真:021-63604199
客户服务热线:95528
公司网址:www.spdb.com.cn

(11)广发银行股份有限公司
注册地址:广东省广州市农林下路 83 号
办公地址:广东省广州市农林下路 83 号
法定代表人:李若虹
客户服务电话:800-830-8003;400-830-8003
网址:www.gdb.com.cn

(12)兴业银行股份有限公司
注册地址:福州市湖东路154号中山大厦
法定代表人:高建平
网址:http://www.cib.com.cn
客户服务电话:95561 或拨打各城市营业网点咨询电话

(13)江苏银行股份有限公司
住所:南京市洪武北路55号
法定代表人:黄志伟
网址:www.jsbchina.cn
客户服务电话:96098、40086-96098

(14)渤海银行股份有限公司
办公地址:天津市河西区马场道 201-205 号
法定代表人:刘宝凤
网址:www.cbhb.com.cn
客户服务电话:400 888 8811

(15)华夏银行股份有限公司
办公地址:北京市东城区建国门内大街 22 号
法定代表人:吴建
客户服务电话:95577
网址:www.hxb.com.cn

(16)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
法定代表人:万建华
电话:021-38676666
传真:021-38670666
联系人:芮敏祺
服务热线:400-8888-666
公司网站:www.gtja.com

(17)光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508 号
法定代表人:徐浩明
电话:021-22169999
传真:021-22161789
联系人: 刘晨
客户服务热线:10108998、4008888788
公司网址:www.ebscn.com

(18)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

(19)中国银河证券股份有限公司
住所: 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: 顾伟国
客户服务电话:4008-888-888
网站:www.chinastock.com.cn

(20)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

(21)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:0755-82943666
联系人:林生迎
客户服务热线:4008888111、95565
公司网址:www.newone.com.cn

(22)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:黄岚
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

(23)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
电话:027-65799999
传真:027-85481900
联系人:李良
客户服务热线:95579或4008-888-999
公司客服网址:www.95579.com

(24)华泰联合证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层(01A、02、03、04)、17A、18A、24A、25A、26A
法定代表人:马昭明
联系人:盛宗凌
电话:0755-82492000
客服电话:95513公司网站:www.lhzq.com

(25)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

(26)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:郑舒丽
电话:0755-22626172
客服电话: 4008816168
公司网址:www.pa18.com

(27)中信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
法定代表人:王东明
电话:010-60838888
传真:010-60833739
联系人:陈忠
公司网址:www.ce.ecitic.com

(28)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:潘鑫军
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

(29)兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路268号
法定代表人:兰荣
电话:021-38565785
联系人:谢高得
客户服务热线:4008888123
公司网站:www.xyzq.com.cn

(30)中信金通证券有限责任公司
住所:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法定代表人:沈强
客户服务电话:96598
公司网址:www.bigsun.com.cn

(31)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16楼至26楼
法定代表人:何如
联系人:齐晓燕
电话:0755-82130833
传真:0755-82133952
客户服务热线:95536
国信证券网站:www.guosen.com.cn

(32)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:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人:张智河
客户咨询电话:0532-96577
公司网址:www.zxwt.com.cn

(33)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:025-84457777-882
传真:025-84579763
联系人:李金龙、张小波
公司网址: www.htsc.com.cn
客户服务热线:95597

(34)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:许刚
咨询电话:4006208888或各地营业网点咨询电话
传真:021-50372474

(35)恒泰证券股份有限公司
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:庞介民
联系人:王旭华
联系电话:0471-4972343
网址:www.cnht.com.cn

(36)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:高峰
电话:0755-83516094
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

(37)渤海证券股份有限公司
注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址:天津市南开区宾水西道8 号
法定代表人: 杜庆平
电话: (022)28451861
传真: (022)28451892
联系人:王兆权
客服电话:400-651-5988
网址:www.bhzq.com

(38)中国建银投资证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至21层
法定代表人: 杨明辉
传真:0755-82026539
客服电话:400-600-8008
网址:www.cjis.cn

(39)国元证券股份有限公司
注册地址:合肥寿春路179号
客户服务热线:4008888777或95578
公司网址:www.gyzq.com.cn

(40)安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼
法定代表人: 牛冠兴
联系电话:0755-82558323
传真:0755-82558355
联系人:余江
客服电话:4008-001-001
公司网址:www.essences.com.cn

(41)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
联系电话:010-65051166或直接联系各营业部
公司网站:http:// www.cicc.com.cn

(42)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

(43)齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市市中区经七路86号
办公地址:山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人:李玮
联系人:吴阳
电话:0531-68889155
传真:0531-68889752
客服电话:95538
网址:www.qlzq.com.cn

(44)广发华福证券有限责任公司
地址:福州市五四路157 号新天地大厦7、8 层
法定代表人:黄金琳
客服电话:96326(福建省外请加拨0591)
公司网址:www.gfhfzq.com.cn

(45)信达证券股份有限公司
办公地址:北京市西城区闹市口大街 9 号院1 号楼信达金融中心
联系人:唐静
联系电话:010-63081000
传真:010-63080978
客服电话:400-800-8899
公司网址:www.cindasc.com

(46)江海证券有限公司
办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号
法定代表人:孙名扬
客服电话:400-666-2288
公司网址:www.jhzq.com.cn

(47)国都证券有限责任公司
注册地址:北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦9 层10 层
法定代表人:常喆
客户服务电话:400-818-8118
网址:www.guodu.com

(48)东兴证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人:徐勇力
基金销售联系人:汤漫川
电话:010-66555316
传真:010-66555246
公司网站:www.dxzq.net.cn
公司客户服务电话:400-8888-993

(49)东北证券股份有限公司
注册地址:长春市自由大路1138号
办公地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:矫正中
电话:0431-85096709
传真:0431-85096795
客服电话:4006000686
网址:www.nesc.cn

(50)德邦证券有限责任公司
注册地址:上海市普陀区曹阳路510号南半幢9楼
办公地址:上海市福山路500号城建国际中心26楼
法定代表人:方加春
联系人:叶蕾
电话:021-68761616
传真:021-68767981
客户服务电话:400-8888-128
网址:www.tebon.com.cn

(51)华安证券有限责任公司
注册地址:安徽省合肥市长江中路357号
办公地址:安徽省合肥市阜南路166号润安大厦A座24层-32层
法定代表人:李工
公司电话:0551-5161666
传真:0551-5161600
网址:www.hazq.com
客户服务电话:96518、400-80-96518

(52)上海证券有限责任公司
注册地址:上海市西藏中路336号上海证券
办公地址:上海市西藏中路336号
法定代表人:郁忠民
联系人:张瑾
电话:021-53519888
传真:021-53519888
网址:www.962518.com
客户服务电话:4008918918、021-962518

(53)方正证券有限责任公司
注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
公司地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人:雷杰
全国统一客服热线:95571
方正证券网站:www.foundersc.com

(54)东海证券有限责任公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
公司地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
法定代表人:朱科敏
全国统一客服热线:400-888-8588
东海证券网站:http://www.longone.com.cn

(55)中航证券有限公司
注册地址:江西省南昌市抚河北路291号
办公地址:江西省南昌市抚河北路291号
法定代表人:杜航
联系人:戴蕾
联系电话:0791-6768681
客服电话:400-8866-567
公司网址:www.avicsec.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)基金注册登记机构:华宝兴业基金管理有限公司(同上)

(三)律师事务所和经办律师
名称:通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:韩炯
联系电话:(86 21)3135 8666
传真: (86 21)3135 8600
联系人:黎 明
经办律师:吕 红、黎 明

(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)23238888
传真:(021)23238800
联系人:张鸿
经办注册会计师:薛竞 张鸿

五、基金简介

基金名称:华宝兴业宝康系列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)、消费品基金

1、投资目标

分享我国全面建设小康社会过程中消费品各相关行业的稳步成长;为基金份额持有人谋求长期稳定回报。

2、投资范围

国内依法发行上市的公司股票和债券以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具,其中投资于消费品类股票的比例不低于股票资产的80%。

3、投资理念

恪守投资边界、策略胜过预测。

4、投资策略

本基金看好消费品的发展前景,长期持有消费品组合,并注重资产在其各相关行业的配置,适当进行时机选择。

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%-75%;债券为20%-45%,现金比例在5%以上。在极端情况下,比如市场投机气氛浓烈、系统性风险急剧增加时,投资比例可作一定调整,但在合理时间内,投资比例将恢复正常水平。

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。

(1)股票投资策略:注重资产在消费品各相关行业的资产配置,以长期持有为主,适当进行时机选择,优化组合。

注重资产在消费品各相关行业的配置

主要采用自上而下的方法:本基金的研究人员对国际国内经济形势、各行业的景气程度作出判断,挑选出处于成长阶段的消费品子行业作为投资重点。

消费品具有良好的增长前景,对于精选出来的个股,我们将坚持长期持有的策略

精选个股主要采用股票选择流程与自下而上的方法:根据消费品股票综合评级系统对备选库股票进行评级排序。研究员研究公司的公开信息,从中寻找行业内业绩较好、有发展前景、价值被低估的公司,投资管理人员也根据股票市场表现提出建议,在此基础上,研究员对其中最有价值的一些公司进行实地调研,了解其治理机制、管理层和产品等方面的情况。对于这些精选出来的个股,我们将结合市场情况,采用长期持有的策略。

同时,我国证券市场具有新兴加转轨的特点,大幅波动的可能性依然存在,所以我们将依据市场判断和政策分析,适当采用时机选择策略,以优化组合表现。

(2)债券投资策略主要采用消极防御策略和积极主动投资策略相结合的投资策略。

部分债券采用消极防御策略;部分债券投资采取积极主动投资策略,通过预测利率变动和行业利差变化并调整相应投资组合获取潜在高额收益。

本基金采用的分析方法为历史数据分析法和情景分析法;研究和调研的重点放在宏观经济形势和财政、货币政策,预测利率变动趋势以及发债公司的信用评估等方面

本基金采取自上而下的投资决策与自下而上的个券选择相结合的投资管理程序,包括三个层次:对市场利率分析、预测;债券资产配置及相应的技术手段;个券选择。

5、业绩比较基准

上证180指数和深证100指数的复合指数*80%+中信标普全债指数*20%。

本基金大类资产投资比例的规定与复合指数和中信标普全债指数的比例配置基本匹配。

上证180指数、深证100指数认知度高,具有权威性;中信标普全债指数是覆盖所有债券的指数,能全面反映债券市场情况。

(二)、灵活配置基金

1、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。

2、投资范围

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允许基金投资的其它金融工具。

债券投资方面,主要投资交易所和银行间债券市场上的各类债券,包括国债、金融债、企业债、可转债等。股票投资方面,主要投资对象为上证180指数、深圳100指数的成分股。

3、投资理念

把握市场特点,灵活配置资产;稳健投资,追求卓越回报。

4、投资策略

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。

本基金通过量化辅助工具及研究支持,结合自身的市场研判,对相关资产类别的预期收益进行动态监控,在一定阶段可显著改变资产配置比例。同时通过仓位与时间的二维管理,控制风险,增强盈利。

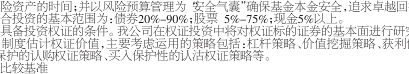
债券投资采取稳健的投资策略,所构建的投资组合将跟踪市场久期,并根据市场利率预期变动主动调整,使组合久期适度偏离。股票投资方面,以指数化投资分散非系统风险,增强流动性,并通过三层复合保障措施严格控制其投资风险:只有当股票投资时机预警系统发出买卖股票提示时,才开始考虑或进行股票市场指数化投资;同时通过仓位与时间的二维管理,控制持有高风险资产的时间;并以风险预算管理为"安全气囊"确保基金本金安全,追求卓越回报。

基金组合投资的基本范围为:债券20%-90%;股票 5%-75%;现金5%以上。

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。

5、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。



本基金大类资产投资比例的规定与复合指数和中信标普全债指数的比例配置基本匹配。

上证180指数、深证100指数认知度高,具有权威性;中信标普全债指数是覆盖所有债券的指数,能全面反映债券市场情况。

(三)、债券基金

1、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。

2、投资理念

以价值分析为基础,以系统化的定量分析技术和严格的投资管理为手段,从市场低效和市场转型过程中发掘投资机会,实现投资组合增值。

3、投资方向

本基金投资范围主要为固定收益类金融工具,包括国内依法公开发行、上市的国债、金融债、企业债(包括可转债),现金和回购等,以及中国证监会允许基金投资的与固定收益类金融工具相关的其他金融工具。本基金还会择机进行新股申购,但新股投资比例不超过基金资产总值20%,所投资的新股上市流通后持有期不超过1年,可转换债券不转换成股票。

4、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,并把握市场创新机会。(1)类属配置包括现金、各市场债券及各债券种类间的配置

主要根据各类属相对投资价值确定,增持相对低估、预期价格上升的类属,减持相对高估、预期价格下跌的类属,从而取得较高的回报。

(2)久期偏离

久期是衡量利率敏感性的一个指标,如果预期利率下降,则应增加组合久期,如预期利率上升,则应减小组合久期,以规避债券价格下跌的风险。该策略的关键是对未来利率走向的预测。

(3)收益率曲线配置

收益率曲线展示了收益与期限的关系,收益率曲线的形状随时间而变化。收益率曲线配置策略是以对债券收益率曲线形状变动的预期为依据建立组合头寸,可以采用集中策略、两端策略和梯形策略等,在长期、中期和短期债券间进行配置,以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

(4)特定券种选择

针对特定的企业债(含可转债)采用逐个分析的方法,具体分析指标包括:经营分析、信用分析、收益率分析、税赋分析等,挖掘特定券种的投资价值。

(5)把握市场创新机会

近期债券市场转型的具体内容包括:利率市场化;交易主体结构逐步改善;交易品种创新,如贴现债券、本息分离债等相继面市,为未来推出利率互换(Swaps)等衍生工具创造条件;债券发行方式与交易方式的创新,美国式利率招标以及银行间债券市场悄然开展的远期利率交易,使将来推出利率期货交易成为可能。

5、业绩比较基准

中信标普全债指数。

中信标普全债指数是覆盖所有债券的指数,能全面反映债券市场情况。

(四)、投资程序

1、公司研究部通过内部独立研究,并借鉴其它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它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、风险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,并授权风险控制小组进行日常跟踪,出具风险分析报告。风险管理部对基金投资过程进行日常监督。

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。

(五)、基金的禁止行为

1、 从事证券承销行为;
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,但是国务院另有规定的除外;
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、法规有关规定,由国务院证券监督管理机构规定禁止从事的其他行为。

(六)、基金投资组合比例限制

1、 各基金投资于国债的比例不低于20%;
2、 各基金投资于股票、债券的比例不低于该基金资产总值的80%;
3、 各基金持有一家公司的股票,不得超过该基金资产净值的10%;
4、 各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%;
5、 基金财产参与股票发行申购,单只基金所申报的金额不得超过该基金的总资产,单只基金所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

由于证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述3、4条或《基金合同》约定的投资比例的,基金管理人应在10个交易日内进行调整,以达到标准。

6、 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。

7、 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。

(七)、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、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利,保护基金投资人的利益。

七、基金的投资组合报告

本系列基金的投资组合报告所载的数据截至2011年6月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

(一)宝康消费品证券投资基金

(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	2,146,443,940.94	71.97
	其中:股票	2,146,443,940.94	71.97
2	固定收益投资	624,837,000.00	20.95
	其中:债券	624,837,000.00	20.95
	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	197,719,959.21	6.63
6	其他资产	13,403,900.75	0.45
7	合计	2,982,404,800.90	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	58,105,403.60	1.96
B	采掘业	-	-
C	制造业	1,371,830,847.14	46.27
C0	食品、饮料	508,680,753.19	17.16
C1	纺织、服装、皮毛	41,072,340.00	1.39
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	88,629,854.77	2.99
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	129,361,886.68	4.36
C7	机械、设备、仪表	358,189,411.00	12.08
C8	医药、生物制品	182,357,978.56	6.15
C99	其他制造业	63,538,622.94	2.14
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	14,583,727.86	0.49
F	交通运输、仓储业	26,350,000.00	0.89
G	信息技术业	24,146,426.49	0.81
H	批发和零售贸易	220,174,639.91	7.43
I	金融、保险业	142,264,375.64	4.80
J	房地产业	82,990,712.70	2.80
K	社会服务业	139,836,048.00	4.72
L	传播与文化产业	9,760,000.00	0.33
M	综合类	56,401,759.60	1.90
	合计	2,146,443,940.94	72.39

(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	000858	五 粮 液	3,500,095	125,023,393.40	4.22
2	000895	双汇发展	1,720,326	113,661,938.82	3.83
3	000069	华侨城A	13,800,132	109,159,044.12	3.68
4	000527	美的电器	4,800,128	88,274,353.92	2.98
5	600519	贵州茅台	400,094	85,071,987.22	2.87
6	600104	上海汽车	4,500,000	84,330,000.00	2.84
7	600690	青岛海尔	2,853,166	79,745,989.70	2.69
8	002032	苏 泊 尔	3,300,064	74,977,454.08	2.53
9	600858	银座股份	2,900,000	59,276,000.00	2.00
10	600415	XR小商品	4,589,240	56,401,759.60	1.90

(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	39,900,000.00	1.35
2	央行票据	458,813,000.00	15.47
3	金融债券	120,845,000.00	4.08
	其中:政策性金融债	120,845,000.00	4.08
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	5,279,000.00	0.18
8	其他	-	-
9	合计	624,837,000.00	21.07

(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	1001092	10央行票据92	1,800,000	175,248,000.00	5.91
2	1001047	10央行票据47	1,000,000	97,730,000.00	3.30
3	1101028	11央行票据28	1,000,000	96,510,000.00	3.25
4	1101023	11央行票据23	900,000	89,325,000.00	3.01
5	080215	08国开15	500,000	50,685,000.00	1.71

(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)申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2011年5月28日宜宾五粮液股份有限公司发布《五粮液收到中国证监会<行政处罚决定书>公告》。五粮液于2011年5月27日下午收到了中国证券监督管理委员会《行政处罚决定书》([2011]17号),该决定书对五粮液股份有限公司及相关责任人进行了行政处罚。

本基金管理人通过对该上市公司进行的进一步了解和分析,认为该处罚不会对五粮液投资价值构成实质性影响,因此本基金管理人对该上市公司的投资判断未发生改变。

报告期内,本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

2)本基金主要投资对象为消费品类股票,基金管理人建立有基金股票备选库。本报告期内本基金的前十名股票投资没有超出基金合同规定的股票备选库。

3)其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,178,718.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,098,295.38
4	应收利息	7,915,149.88
5	应收申购款	211,736.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,403,900.75

4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	5,279,000.00	0.18

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未存在流通受限情况。

2、宝康灵活配置证券投资基金

(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	767,239,765.80	71.98
	其中:股票	767,239,765.80	71.98
2	固定收益投资	248,869,178.30	23.35
	其中:债券	248,869,178.30	23.35
	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	43,600,760.23	4.09
6	其他资产	6,214,542.18	0.58
7	合计	1,065,924,246.51	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	3,656,713.35	0.35
B	采掘业	72,279,499.37	6.87
C	制造业	345,360,533.41	32.83
C0	食品、饮料	38,103,329.79	3.62
C1	纺织、服装、皮毛	10,206,705.36	0.97
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	10,380,000.00	0.99
C4	石油、化学、塑胶、塑料	39,681,036.72	3.77
C5	电子	7,968,806.33	0.76
C6	金属、非金属	53,374,698.75	5.07
C7	机械、设备、仪表	159,031,626.26	15.12
C8	医药、生物制品	25,502,194.35	2.42
C99	其他制造业	1,112,135.85	0.11
D	电力、煤气及水的生产和供应业	13,871,884.45	1.32
E	建筑业	19,777,669.95	1.88
F	交通运输、仓储业	23,168,495.47	2.20
G	信息技术业	20,202,197.18	1.92
H	批发和零售贸易	36,280,751.45	3.45
I	金融、保险业	156,650,047.12	14.89
J	房地产业	29,122,829.89	2.77
K	社会服务业	28,145,275.81	2.68
L	传播与文化产业	1,312,779.96	0.12
M	综合类	17,411,088.39	1.65
	合计	767,239,765.80	72.93

(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	575,944	23,037,760.00	2.19
2	002358	森源电气	972,598	18,547,443.86	1.76
3	002503	搜于特	533,324	17,557,026.08	1.67
4	600036	招商银行	1,339,057	17,434,522.14	1.66
5	601318	中国平安	360,506	17,401,624.62	1.65
6	300124	汇川技术	239,378	16,493,144.20	1.57
7	600016	民生银行	2,445,272	14,011,408.56	1.33
8	601328	交通银行	2,409,048	13,346,125.92	1.27
9	002367	康力电梯	750,000	12,885,000.00	1.22
10	600000	浦发银行	1,204,786	11,855,094.24	1.13

(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	94,102,309.40	8.94
2	央行票据	99,240,000.00	9.43
3	金融债券	50,685,000.00	4.82
	其中:政策性金融债	50,685,000.00	4.82
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	4,841,868.90	0.46
8	其他	-	-
9	合计	248,869,178.30	23.66

(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	010110	21国债(10)	898,670	89,705,239.40	8.53
2	080215	08国开15	500,000	50,685,000.00	4.82
3	1101023	11央行票据23	500,000	49,625,000.00	4.72
4	1101029	11央行票据29	500,000	49,615,000.00	4.72
5	113002	工行转债	40,870	4,841,868.90	0.46

(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)本基金建立有基金股票备选库。本报告期内本基金的前十名股票投资没有超出基金合同规定的股票备选库。

3)其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	890,741.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	635,920.32
4	应收利息	4,639,853.86
5	应收申购款	48,027.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,214,542.18

4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	4,841,868.90	0.46

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未存在流通受限情况。

3、宝康债券投资基金

(1)报告期末基金资产组合情况

(下转D46版)