(上接D38版)

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	210,097,112.02	7.48
C	制造业	721,877,858.88	25.69
C0	食品、饮料	563,202,967.91	20.04
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	14,575,032.32	0.52
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	110,831,827.35	3.94
C8	医药、生物制品	33,268,031.30	1.18
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	184,608,721.78	6.57
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	42,685,572.65	1.52
H	批发和零售贸易	33,353,622.72	1.19
I	金融、保险业	172,533,577.19	6.14
J	房地产业	315,375,930.69	11.22
K	社会服务业	276,855,161.24	9.85
L	传播与文化产业	105,046,591.80	3.74
M	综合类	-	-
	合计	2,062,434,148.97	73.39

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

代码	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	002051	中工国际	7,586,124	204,294,319.32	7.27
2	000895	双汇发展	2,700,042	186,032,893.80	6.62
3	300058	蓝色光标	3,876,258	105,046,591.80	3.74
4	000002	万 科A	11,985,080	99,236,462.40	3.53
5	601166	兴业银行	6,999,948	93,239,307.36	3.32
6	600519	贵州茅台	446.113	87,866,416.48	3.13
7	600809	山西汾酒	1,410,565	86,566,374.05	3.08
8	600887	伊利股份	3,749,857	82,646,848.28	2.94
9	000858	五 粮 液	2,500,470	82,115,434.80	2.92
10	002375	亚厦股份	2,633,086	76,333,163.14	2.72

4.报告期末按券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	96,820,000.00	3.45
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	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	96,820,000.00	3.45

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	1101028	11央行票据28	1,000,000	96,820,000.00	3.45
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）声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）本基金股票投资的主要对象是稳定分红的股票，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）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,903,925.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,112,751.07
5	应收申购款	61,394.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,078,071.35

（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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000895	双汇发展	186,032,893.80	6.62	重大资产重组

七、基金的业绩

基金业绩截止日为2012年3月31日。基金过往业绩不代表未来表现，本报告中所列数据未经审计。

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
2006/06/15-2006/12/31	46.17%	0.90%	38.78%	0.96%	7.39%	-0.06%
2007/01/01-2007/12/31	167.63%	2.00%	89.90%	1.74%	77.73%	0.26%
2008/01/01-2008/12/31	-53.69%	2.62%	-50.28%	2.08%	-3.41%	0.54%
2009/01/01-2009/12/31	91.39%	1.70%	56.59%	1.40%	34.80%	0.30%
2010/01/01-2010/12/31	-6.40%	1.36%	-13.74%	0.94%	7.34%	0.42%
2011/01/01-2011/12/31	-21.40%	0.98%	-10.86%	0.76%	-10.54%	0.22%
2012/01/01-2012/03/31	-0.09%	1.19%	3.12%	0.84%	-3.21%	0.35%
2006/06/15-2012/03/31	154.85%	1.75%	62.71%	1.42%	92.14%	0.33%

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

华宝兴业收益增长混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2006年6月15日至2012年3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2006年12月15日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

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（例如基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

八、基金份额的申购和赎回

（一）基金份额申购和赎回的场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。具体销售网点将由基金管理人在基金份额发售公告或其他公告中列明。基金管理人可以根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。

投资人可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。具体办法另行公告。

（二）申购与赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及时间进行相应的调整并公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金自2006年7月13日起开始办理日常申购业务。

本基金自2006年9月5日起开始办理日常赎回业务。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

（三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人在该销售机构的基金份额进行处理时，申（认）购确认日期在先的基金份额先赎回，申（认）购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

4、当日的申购与赎回申请可以在当日交易时间结束前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前3个工作日予以公告。

（四）申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的交易时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。

2、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前收到申购和赎回申请的当日作为申购或赎回申请日（T日），并在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人可在T+2日到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额交款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项本金退还给投资人。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按基金合同有关规定处理。

（五）申购与赎回的数额限制

1、申请申购基金的金额

通过代销网点和直销e网金申购本基金单笔最低金额为1,000元人民币（含申购费）。通过直销柜台首次申购的最低金额为10万元人民币（含申购费），追加申购最低金额为1,000元人民币（含申购费）。已有认购本基金记录的投资人不受首次申购最低金额的限制，但受追加申购最低金额的限制。

代销网点和直销e网金的投资人欲转入直销柜台进行交易要受直销柜台最低金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整首次申购的最低金额。

投资人可多次申购，对单个投资人累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

2、申请赎回基金的份额

投资人可将其全部或部分基金份额赎回。本基金按照份额进行赎回，申请赎回份额精确到小数点后两位，单笔赎回份额不得低于100份。基金持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足100份的，在赎回时需一次全部赎回。

3、基金管理人可以规定投资人每个交易账户的最低基金份额余额

基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前3个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。

（六）申购和赎回的价格、费用及其用途

1、申购费和赎回费

①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。

②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赎回人承担，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。

2、申购份额与赎回金额的计算方式

①申购份额的计算

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。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赎回金额的计算

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

赎回价格=赎回日基金份额净值

赎回总额=赎回份额×赎回价格

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

赎回总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，赎回金额为赎回总额扣除相应的费用。赎回总额、赎回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。

3、T日的基金份额净值在当日收市后计算，并在T+1日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金份额总额。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

4、本基金份额净值的计算，保留到小数点后四位，小数点后第五位四舍五入，由此产生的误差在基金财产中列支。

5、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前3个工作日前在至少一种指定媒体公告。

九、与基金管理人管理的其他基金转换

（一）基金转换申请人的范围

本基金的持有人均可以按照基金合同的规定申请和办理本基金与基金管理人管理的其他基金的转换。

（二）基金转换受理场所

本公司直销柜台、直销e网金、中国建设银行、中国银行、交通银行、中信银行、民生银行、浦发银行、广发银行、兴业银行、江苏银行、渤海银行、招商银行、华夏银行、中银万国证券、国泰君安证券、海通证券、兴业证券、中信建投证券、招商证券、光大证券、长江证券、东吴证券、中信金通证券、渤海证券、恒泰证券、中投证券、中信证券、平安证券、广发证券、华福证券、江海证券、国都证券、东兴证券、德邦证券、华安证券、东北证券、上海证券和方正证券受理本基金与公司管理的宝康系列基金、现金宝货币市场基金、多策略增长基金、先进成长基金、行业精选基金、动力组合基金、大盘精选基金、中证100指数基金（前端收费模式）间的转换业务。

东海证券已开通本基金与公司管理的宝康系列基金、现金宝货币市场基金、多策略增长基金、先进成长基金、收益增长基金、动力组合基金、大盘精选基金、增强收益债券基金、中证100指数基金（前端收费模式）间的转换业务。

本公司直销柜台、直销e网金、中国建设银行、中国银行、中国农业银行、交通银行、中国民生银行、招商银行、中信银行、深圳发展银行、上海浦东发展银行、渤海银行、江苏银行、华夏银行、银万国证券、国泰君安证券、光大证券、海通证券、中国银河证券、中信建投证券、招商证券、广发证券、长江证券、国信证券、中信金通证券、中信万通证券、平安证券、东方证券、兴业证券、华泰证券、中银国际证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、东吴证券、中信证券、江海证券、安信证券、中国国际金融公司、华宝证券、华安证券、齐鲁证券、华福证券、信达证券、国都证券、东北证券、德邦证券、华安证券、上海证券、东海证券已开通本基金与可转债基金之间的转换业务。

本公司直销柜台、直销e网金、招商银行、中国建设银行、中国银行、交通银行、中国民生银行、中信银行、深圳发展银行、上海浦东发展银行、兴业银行、江苏银行、渤海银行、国泰君安证券、光大证券、海通证券、中国银河证券、中信建投证券、招商证券、广发证券、长江证券、东吴证券、中银万国证券、平安证券、中信证券、东方证券、兴业证券、中信金通证券、国信证券、华泰证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、中投证券、安信证券、中国国际金融公司、华宝证券、齐鲁证券、华福证券、信达证券、江海证券、国都证券、东北证券、德邦证券、华安证券、上海证券、东海证券已开通本基金与可转债基金之间的转换业务。

本公司直销柜台、直销e网金、中国银行、中国建设银行、中国银行、中国农业银行、交通银行、招商银行、上海浦东发展银行、中国民生银行、渤海银行、中信银行、国泰君安证券、中银万国证券、海通证券、光大证券、海通证券、中国银河证券、中信建投证券、广发证券、长江证券、国信证券、中信金通证券、中信万通证券、平安证券、东方证券、兴业证券、华泰证券、中信证券、东方证券、兴业证券、中信证券、国信证券、华泰证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、中投证券、安信证券、中国国际金融公司、华宝证券、齐鲁证券、华福证券、信达证券、江海证券、国都证券、东北证券、德邦证券、华安证券、上海证券、东海证券已开通本基金与上证180或长ETF联接基金的转换业务。

本公司直销柜台、直销e网金、中国建设银行、中国银行、中国农业银行、交通银行、招商银行、中信银行、深圳发展银行、渤海银行、中国民生银行、国泰君安证券、光大证券、海通证券、中国银河证券、广发证券、长江证券、东吴证券、中银万国证券、平安证券、中信证券、东方证券、兴业证券、国信证券、中信万通证券、华泰证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、中投证券、齐鲁证券、华宝证券、上海证券、招商证券、信达证券、国都证券、华安证券、德邦证券、渤海证券、兴业证券、东海证券、江海证券、恒泰证券、国元证券、东吴证券、长城证券、华泰证券、中投证券、平安证券、东北证券、中航证券、安信证券、中银国际证券、中国国际金融公司、中信金通