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2010年1月15日， 有关财务数据和净值表现截止日为2009年12月31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：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

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、华宝信托投资有限责任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、本系列基金基金经理

闫旭女士，硕士。曾在富国基金管理有限公司从事证券研究、交易和投资工作，2004年10月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后曾任多策略增长基金基金经理助理、宝康消费品基金基金经理助理。2007年6月起担任华宝兴业行业精选基金基金经理。2008年4月起担任宝康消费品基金基金经理。

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。

胡戈游先生，硕士，CFA。2005年2月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后曾任金融工程部数量分析师、宝康灵活配置基金基金经理助理。2009年5月起担任宝康灵活配置基金基金经理。

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。

Tan Weisi（谭微思）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。

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、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。
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，多策略增长基金和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、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

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，安永会计师事务所为此提交了“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12月31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、融通通乾封闭、银河银丰封闭等6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、国泰中小盘成长股票、银华沪深300指数（LOF）、光大保德信动态优选混合、华商动态阿尔法灵活配置混合、信达澳银中小盘股票、泰达荷银红利先锋股票、汇丰晋信中小盘股票、华夏盛世精选股票、银河沪深300价值指数、博时超级大盘ETF、博时超级大盘ETF联接、东吴新经济股票基金等137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
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
客户服务统一咨询电话：95566
网址：www.boc.cn

(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) 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
公司网站：www.cmbchina.com

（5）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：董云巍
公司网址：www.cmbc.com.cn
客户服务电话：95568

（6）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

（7）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

（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）
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）广东发展银行股份有限公司
住所：广州市农林下路83号
法定代表人：李若虹
电话：020－38323701
联系人：李晓鹏
网址：www.gdb.com.cn
客户服务热线：400－830－8003

（12）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
公司网址：www.lhzq.com

（13）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

（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

（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
联系人：李良
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
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楼
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
服务热线：0755－26951111、4008888111
联系人：黄健
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
服务热线：021－962505
公司网址：www.sw2000.com.cn或www.sywg.com.cn

（19）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
客户服务热线：4008888777（全国统一客户服务热线）或95578
公司网址：www.gyzq.com.cn

（20）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

（21）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：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

（22）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：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

(23) 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3层
法定代表人：王东明
电话：010－84864818
传真：010－84865560
联系人：陈忠
客户服务热线：010－95558
公司网址：www.ecitic.com

(24) 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

（25）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
公司网址：www.bigsun.com.cn

（26）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
传真：0755－82433794
客户服务热线：4008816168
网站：www.pa18.com

（27）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

(28) 国信证券有限责任公司
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：齐晓燕
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

(29) 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

(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
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
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
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
住所、办公地址：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
电话：0755－83516289
传真：0755－83516199
联系人：匡婷
客户服务热线：0755－33680000、400 6666 888
网址：www.cc168.com.cn

（34）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
网址：www.ewww.com.cn
客户服务电话：400－651－5988

（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
客服电话：4008－001－001
公司网址：www.essences.com.cn

（37）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/

（38）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

（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

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

（41）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

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：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) 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%。

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

成分指数总流通市值＝上证180流通市值＋深证100流通市值

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。

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

成分指数总流通市值＝上证180流通市值＋深证100流通市值

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。内控审计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2009年12月31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（%）
(一) 1	权益投资	2,512,126,419.91	63.87
(二)	其中：股票	2,512,126,419.91	63.87
(三) 2	固定收益投资	812,969,000.00	20.67
(四)	其中：债券	812,969,000.00	20.67
(五)	资产支持证券	－	－
(六) 3	金融衍生品投资	－	－
(七) 4	买入返售金融资产	－	－
(八)	其中：买断式回购的买入返售金融资产	－	－
(九) 5	银行存款和结算备付金合计	581,944,128.31	14.79
(十) 6	其他资产	26,430,438.72	0.67
(十一) 7	合计	3,933,469,986.94	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	(十二) 农、林、牧、渔业	21,922,757.32	0.58
B	(十三) 采掘业	105,483,668.52	2.78
C	(十四) 制造业	1,620,555,434.15	42.68
C0	(十五) 食品、饮料	171,521,923.75	4.52
C1	(十六) 纺织、服装、皮毛	1,097,193.90	0.03
C2	(十七) 木材、家具	－	－
C3	(十八) 造纸、印刷	1,111,368.48	0.03
C4	(十九) 石油、化学、塑胶、塑料	42,033,994.10	1.11
C5	(二十) 电子	54,218,310.55	1.43
C6	(二十一) 金属、非金属	274,632,950.87	7.23
C7	(二十二) 机械、设备、仪表	776,634,063.47	20.45
C8	(二十三) 医药、生物制品	282,218,941.71	7.43
C99	(二十四) 其他制造业	17,086,687.32	0.45
D	(二十五) 电力、煤气及水的生产和供应业	－	－
E	(二十六) 建筑业	1,542,784.32	0.04
F	(二十七) 交通运输、仓储业	197,353,013.16	5.20
G	(二十八) 信息技术业	173,038,910.31	4.56
H	(二十九) 批发和零售贸易	289,049,898.64	7.61
I	(三十) 金融、保险业	67,318,264.34	1.77
J	(三十一) 房地产业	19,037,787.75	0.50
K	(三十二) 社会服务业	13,895,756.22	0.37
L	(三十三) 传播与文化产业	2,928,145.18	0.08
M	(三十四) 综合类	－	－
	(三十五) 合计	2,512,126,419.91	66.16

(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	000800	一汽轿车	7,700,000	200,354,000.00	5.28
2	600104	上海汽车	6,600,000	172,458,000.00	4.54
3	600660	福耀玻璃	10,153,417	151,692,049.98	3.99
4	601111	中国国航	14,599,899	141,765,019.29	3.73
5	600690	青岛海尔	4,057,094	100,575,360.26	2.65
6	600570	恒生电子	4,325,555	90,879,910.55	2.39
7	000527	美的电器	3,609,741	83,745,991.20	2.21
8	600519	贵州茅台	454,918	77,254,174.76	2.03
9	600694	大商股份	1,674,353	73,319,917.87	1.93
10	600216	浙江医药	2,056,776	73,159,522.32	1.93

（下转B26版）