

华宝兴业收益增长混合型证券投资基金

2006年第三季度报告

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司 基金托管人：中国建设银行股份有限公司

一、重要提示

华宝兴业基金管理有限公司董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2006年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

华宝兴业基金管理有限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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

本基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期起止日期为2006年7月1日，截止日期为2006年9月30日。

本报告有关财务资料未经审计。

二、基金基本情况

1、基金名称：华宝兴业收益增长混合型证券投资基金

2、基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

3、基金托管人：中国建设银行股份有限公司

4、基金合同生效日期：2006年6月9日

5、基金募集情况：截至2006年6月15日，本基金共募集基金份额1,263,681,740.01份，募集金额为人民币1,263,681,740.01元。

定价，确定其公允价值，在此基础上再选择出价格低于其合理价值的品种。

3、资产配置策略：以收益曲线模型进行资产配置，并预期其未来形态变化，选择收益率曲线上斜率最高区进行资产配置，买入曲线中端品种，等待其利率年期到后自然形成收益下降，从而再调整资产配置。

4、行业配置策略：本基金根据市场的实际情况及基金的申购赎回状况，将部分资产配置于中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具，包括但不限于可转换债券、央行票据、融资融券权证、股指期货等金融工具的使用等。行业配置策略：本基金根据市场实际情况及基金的申购赎回状况，将部分资产配置于中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具，包括但不限于可转换债券、央行票据、融资融券权证、股指期货等金融工具的使用等。

5、风险控制策略：本基金在追求收益增长的同时，严格控制基金资产的风险。本基金投资于股票资产的比例不超过基金资产净值的65%，投资于可转债资产的比例不超过基金资产净值的35%。

大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

3、投资策略和业绩比较基准：本基金为混合型证券投资基金，主要投资于股票、债券、货币市场工具等。业绩比较基准为：沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

4、基金管理人承诺：基金管理人承诺以诚实信用、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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

5、基金托管人承诺：基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

序号	代码	名称	期末市值(元)	市值占基金净值比例
8	000036	招商银行	7,600,000.00	31.14%
9	000001	浦发银行	3,800,000.00	15.57%
10	000025	上海银行	3,800,000.00	15.57%
11	000012	工商银行	3,800,000.00	15.57%
12	000016	民生银行	3,800,000.00	15.57%
13	000022	华夏银行	3,800,000.00	15.57%
14	000028	中信银行	3,800,000.00	15.57%
15	000033	光大银行	3,800,000.00	15.57%
16	000038	兴业银行	3,800,000.00	15.57%
17	000041	广发银行	3,800,000.00	15.57%
18	000043	海南银行	3,800,000.00	15.57%
19	000045	浙江农村	3,800,000.00	15.57%
20	000046	江苏农村	3,800,000.00	15.57%
21	000047	福建农村	3,800,000.00	15.57%
22	000048	江西农村	3,800,000.00	15.57%
23	000049	山东农村	3,800,000.00	15.57%
24	000050	河南农村	3,800,000.00	15.57%
25	000051	河北农村	3,800,000.00	15.57%
26	000052	山西农村	3,800,000.00	15.57%
27	000053	安徽农村	3,800,000.00	15.57%
28	000054	江西农村	3,800,000.00	15.57%
29	000055	广东农村	3,800,000.00	15.57%
30	000056	广西农村	3,800,000.00	15.57%
31	000057	四川农村	3,800,000.00	15.57%
32	000058	贵州农村	3,800,000.00	15.57%
33	000059	云南农村	3,800,000.00	15.57%
34	000060	陕西农村	3,800,000.00	15.57%
35	000061	甘肃农村	3,800,000.00	15.57%
36	000062	宁夏农村	3,800,000.00	15.57%
37	000063	青海农村	3,800,000.00	15.57%
38	000064	西藏农村	3,800,000.00	15.57%
39	000065	新疆农村	3,800,000.00	15.57%
40	000066	内蒙古农村	3,800,000.00	15.57%
41	000067	吉林农村	3,800,000.00	15.57%
42	000068	辽宁农村	3,800,000.00	15.57%
43	000069	黑龙江农村	3,800,000.00	15.57%
44	000070	河北农村	3,800,000.00	15.57%
45	000071	山西农村	3,800,000.00	15.57%
46	000072	山东农村	3,800,000.00	15.57%
47	000073	河南农村	3,800,000.00	15.57%
48	000074	湖北农村	3,800,000.00	15.57%
49	000075	湖南农村	3,800,000.00	15.57%
50	000076	广东农村	3,800,000.00	15.57%
51	000077	广西农村	3,800,000.00	15.57%
52	000078	四川农村	3,800,000.00	15.57%
53	000079	贵州农村	3,800,000.00	15.57%
54	000080	云南农村	3,800,000.00	15.57%
55	000081	陕西农村	3,800,000.00	15.57%
56	000082	甘肃农村	3,800,000.00	15.57%
57	000083	宁夏农村	3,800,000.00	15.57%
58	000084	青海农村	3,800,000.00	15.57%
59	000085	西藏农村	3,800,000.00	15.57%
60	000086	新疆农村	3,800,000.00	15.57%
61	000087	内蒙古农村	3,800,000.00	15.57%
62	000088	吉林农村	3,800,000.00	15.57%
63	000089	辽宁农村	3,800,000.00	15.57%
64	000090	黑龙江农村	3,800,000.00	15.57%
65	000091	河北农村	3,800,000.00	15.57%
66	000092	山西农村	3,800,000.00	15.57%
67	000093	山东农村	3,800,000.00	15.57%
68	000094	河南农村	3,800,000.00	15.57%
69	000095	湖北农村	3,800,000.00	15.57%
70	000096	湖南农村	3,800,000.00	15.57%
71	000097	广东农村	3,800,000.00	15.57%
72	000098	广西农村	3,800,000.00	15.57%
73	000099	四川农村	3,800,000.00	15.57%
74	000100	贵州农村	3,800,000.00	15.57%
75	000101	云南农村	3,800,000.00	15.57%
76	000102	陕西农村	3,800,000.00	15.57%
77	000103	甘肃农村	3,800,000.00	15.57%
78	000104	宁夏农村	3,800,000.00	15.57%
79	000105	青海农村	3,800,000.00	15.57%
80	000106	西藏农村	3,800,000.00	15.57%
81	000107	新疆农村	3,800,000.00	15.57%
82	000108	内蒙古农村	3,800,000.00	15.57%
83	000109	吉林农村	3,800,000.00	15.57%
84	000110	辽宁农村	3,800,000.00	15.57%
85	000111	黑龙江农村	3,800,000.00	15.57%
86	000112	河北农村	3,800,000.00	15.57%
87	000113	山西农村	3,800,000.00	15.57%
88	000114	山东农村	3,800,000.00	15.57%
89	000115	河南农村	3,800,000.00	15.57%
90	000116	湖北农村	3,800,000.00	15.57%
91	000117	湖南农村	3,800,000.00	15.57%
92	000118	广东农村	3,800,000.00	15.57%
93	000119	广西农村	3,800,000.00	15.57%
94	000120	四川农村	3,800,000.00	15.57%
95	000121	贵州农村	3,800,000.00	15.57%
96	000122	云南农村	3,800,000.00	15.57%
97	000123	陕西农村	3,800,000.00	15.57%
98	000124	甘肃农村	3,800,000.00	15.57%
99	000125	宁夏农村	3,800,000.00	15.57%
100	000126	青海农村	3,800,000.00	15.57%
101	000127	西藏农村	3,800,000.00	15.57%
102	000128	新疆农村	3,800,000.00	15.57%
103	000129	内蒙古农村	3,800,000.00	15.57%
104	000130	吉林农村	3,800,000.00	15.57%
105	000131	辽宁农村	3,800,000.00	15.57%
106	000132	黑龙江农村	3,800,000.00	15.57%
107	000133	河北农村	3,800,000.00	15.57%
108	000134	山西农村	3,800,000.00	15.57%
109	000135	山东农村	3,800,000.00	15.57%
110	000136	河南农村	3,800,000.00	15.57%
111	000137	湖北农村	3,800,000.00	15.57%
112	000138	湖南农村	3,800,000.00	15.57%
113	000139	广东农村	3,800,000.00	15.57%
114	000140	广西农村	3,800,000.00	15.57%
115	000141	四川农村	3,800,000.00	15.57%
116	000142	贵州农村	3,800,000.00	15.57%
117	000143	云南农村	3,800,000.00	15.57%
118	000144	陕西农村	3,800,000.00	15.57%
119	000145	甘肃农村	3,800,000.00	15.57%
120	000146	宁夏农村	3,800,000.00	15.57%
121	000147	青海农村	3,800,000.00	15.57%
122	000148	西藏农村	3,800,000.00	15.57%
123	000149	新疆农村	3,800,000.00	15.57%
124	000150	内蒙古农村	3,800,000.00	15.57%
125	000151	吉林农村	3,800,000.00	15.57%
126	000152	辽宁农村	3,800,000.00	15.57%
127	000153	黑龙江农村	3,800,000.00	15.57%
128	000154	河北农村	3,800,000.00	15.57%
129	000155	山西农村	3,800,000.00	15.57%
130	000156	山东农村	3,800,000.00	15.57%
131	000157	河南农村	3,800,000.00	15.57%
132	000158	湖北农村	3,800,000.00	15.57%
133	000159	湖南农村	3,800,000.00	15.57%
134	000160	广东农村	3,800,000.00	15.57%
135	000161	广西农村	3,800,000.00	15.57%
136	000162	四川农村	3,800,000.00	15.57%
137	000163	贵州农村	3,800,000.00	15.57%
138	000164	云南农村	3,800,000.00	15.57%
139	000165	陕西农村	3,800,000.00	15.57%
140	000166	甘肃农村	3,800,000.00	15.57%
141	000167	宁夏农村	3,800,000.00	15.57%
142	000168	青海农村	3,800,000.00	15.57%
143	000169	西藏农村	3,800,000.00	15.57%
144	000170	新疆农村	3,800,000.00	15.57%
145	000171	内蒙古农村	3,800,000.00	15.57%
146	000172	吉林农村	3,800,000.00	15.57%
147	000173	辽宁农村	3,800,000.00	15.57%
148	000174	黑龙江农村	3,800,000.00	15.57%
149	000175	河北农村	3,800,000.00	15.57%
150	000176	山西农村	3,800,000.00	15.57%
151	000177	山东农村	3,800,000.00	15.57%
152	000178	河南农村	3,800,000.00	15.57%
153	000179	湖北农村	3,800,000.00	15.57%
154	000180	湖南农村	3,800,000.00	15.57%
155	000181	广东农村	3,800,000.00	15.57%
156	000182	广西农村	3,800,000.00	15.57%
157	000183	四川农村	3,800,000.00	15.57%
158	000184	贵州农村	3,800,000.00	15.57%
159	000185	云南农村	3,800,000.00	15.57%
160	000186	陕西农村	3,800,000.00	15.57%
161	000187	甘肃农村	3,800,000.00	15.57%
162	000188	宁夏农村	3,800,000.00	15.57%
163	000189	青海农村	3,800,000.00	15.57%
164	000190	西藏农村	3,800,000.00	15.57%
165	000191	新疆农村	3,800,000.00	15.57%
166	000192	内蒙古农村	3,800,000.00	15.57%
167	000193	吉林农村	3,800,000.00	15.57%
168	000194	辽宁农村	3,800,000.00	15.57%
169	000195	黑龙江农村	3,800,000.00	15.57%
170	000196	河北农村	3,800,000.00	15.57%
171	000197	山西农村	3,800,000.00	15.57%
172	000198	山东农村	3,800,000.00	15.57%
173	000199	河南农村	3,800,000.00	15.57%
174	000200	湖北农村	3,800,000.00	15.57%

三、基金业绩表现

截至2006年9月30日，本基金资产净值1,263,681,740.01元，基金份额净值1.0000元。

四、基金投资组合

1、股票投资组合：截至2006年9月30日，本基金股票资产净值1,263,681,740.01元，占基金资产净值的100%。

2、债券投资组合：截至2006年9月30日，本基金债券资产净值0元，占基金资产净值的0%。

3、货币市场工具：截至2006年9月30日，本基金货币市场工具资产净值0元，占基金资产净值的0%。

4、其他资产：截至2006年9月30日，本基金其他资产净值0元，占基金资产净值的0%。

五、基金管理人承诺

基金管理人承诺以诚实信用、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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

六、基金托管人承诺

基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

七、基金业绩表现

截至200