# 华宝兴业收益增长混合型证券投资基金 2006年年度报告摘要

## 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

### 重要提示

基金管理人的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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2007年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

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。

本报告期起始日期为2006年1月1日,截止日期为2006年12月31日。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

### 第一章 基金简介

1.基金运作方式

华宝兴业收益增长混合型证券投资基金为契约型开放式基金。存续期间为永久存续。

2.基金管理人、托管人及基金合同生效日期

华宝兴业收益增长混合型证券投资基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司,托管人为中国建设银行股份有限公司,2006年6月9日募集结束并于2006年6月15日基金合同正式生效。

3.基金简称、交易代码及基金份额

本基金的简称、交易代码、本报告期末基金份额总额列表如下:

| 基金简称 | 交易代码 | 期末基金份额总额(份) |
|---|---|---|
| 收益增长 | 240008 | 1,551,097,894.81 |

4.基金投资目标、投资策略、业绩比较基准及风险收益特征

投资目标:投资稳定分红和有分红潜力的价值被低估上市公司,以分享该类上市公司的长期稳定的股息收入及资本增值。

投资策略:本基金采取积极的资产配置策略,通过公司自行开发的数量化辅助模型,结合宏观策略研究,对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪,决定大类资产配置比例。在正常的市场情况下,本基金的投资比例范围为:股票占基金资产净值的30%–95%,权证占0%–3%,债券占0%–70%,现金或者到期日在一年内的政府债券比例在5%以上。其中投资于稳定分红股票的比例不低于股票资产的80%。稳定分红指过去三年内至少两次实施现金红利分配。

(1)股票投资策略

1)定量分析与定性分析相结合的策略

a.定量选股标准

根据华宝兴业股票估值系统,综合考虑稳定分红和有分红潜力的价值被低估上市公司的价值指标、成长指标和盈利指标,重点投资综合排名靠前的股票。

b.定性选股标准

针对稳定分红类上市公司,本基金重点关注有核心竞争力、有良好发展前景、管理层注重投资者的现金回报、具有长期战略规划、不盲目投资的上市公司。

针对有分红潜力的价值被低估上市公司,重点关注处于行业周期底部区域而被低估的上市公司;重置成本已经提高,账面资产未反映而被低估的上市公司;被市场忽略而被低估的上市公司;具有较大并购价值的被低估的上市公司;相对成熟市场被低估的上市公司;市场前景被低估的上市公司。

2)行业配置策略

通过定量分析与定性分析相结合策略形成的组合的行业比例为本基金的基本行业配置比例,通过对宏观经济、政策尤其是产业政策的深入分析,加大对政策扶持、发展前景良好的行业的配置比例。

3)定期调整策略

根据上市公司过去三年的分红情况和研究员的分析定期调整基准池;根据定量分析和定性分析相结合的策略、行业配置策略,结合公司三级股票库定期调整投资组合。

(2) 债券投资策略

本基金将通过大资产配置、分类资产配置和个券选择三个层次自上而下进行债券投资管理,以实现稳定收益和充分流动性的投资目标。

大资产配置主要是通过对宏观经济趋势、金融货币政策和利率趋势的判断对货币资产和债券类资产进行选择配置,同时也在银行间市场、交易所债券市场进行选择配置。

分类资产配置主要通过分析债券市场变化、投资人行为、品种间相对价值变化、债券供求关系变化和信用分析进行分类品种配置。可选择配置的品种范围有国债、金融债、企业债、央票、短期融资券。

品种选择上,主要通过利率趋势分析、投资人偏好分析、对收益率曲线形态变化的预期、信用评估、市场收益率定价、流动性分析,筛选出流动性良好,成交活跃、符合目标久期、到期收益率有优势且信用风险较低的券种。

主要采用的投资策略包括:

1)久期灵活管理:在对宏观经济趋势、金融货币政策和利率趋势的判断基础上,确定债券组合久期目标范围,在可接受范围内可以按照市场实际变化灵活管理久期长短,以获取市场超额收益。

2)曲线合理定价:按照市场各品种实际成交情况,得出合理收益率曲线,使用该曲线对备选品种进行合理定价,确定其公允价格,在此基础上筛选出价格低于其合理价值的品种。

3)曲线下滑策略:对收益率曲线形态进行分析,并预测其未来形态变化,选择收益率曲线段上斜率最高区间进行下滑操作,买入曲线上端品种,等待其剩余年期缩短而自然形成收益率下滑,从而得到超额下滑利润。

(3) 其他品种投资策略

本基金将根据市场的实际情况及基金的申购赎回状况,将部分资产投资于中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具,包括但不限于可转换债券、央行票据,捕捉市场机会,提高基金资产的使用效率。央行票据的投资策略见债券投资策略,可转换债券采用自上而下的两层次配置策略,在对宏观经济、行业分析的基础上,选择有成长性、前景看好的行业进行配置。最后落实到个股分析、转债具体条款分析、股性、债性分析上。利用转债的债性规避股市系统性风险和个股风险、追求投资组合的安全和稳定收益,并利用其股性在股市上涨中分享到行业和公司成长带来的收益。

另外,本基金具备投资权证的条件。本基金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。

业绩比较基准: 65%上证红利指数收益率+35%上证国债指数收益率。

风险收益特征:本基金是混合型基金,风险高于债券基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中等风险品种。

5.基金管理人有关情况

名称:华宝兴业基金管理有限公司

信息披露负责人: 刘月华

联系电话:021–50499588

传真:021–50499688

电子信箱: xxpl@fsfund.com

6.基金托管人有关情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称"中国建设银行")

信息披露负责人:尹东

联系电话:010—67595104

传真:010—66275853

电子信箱:yindong.zh@ccb.cn

7.基金信息披露媒体及其他

本基金登载年度报告正文的互联网网址:www.fsfund.com

本基金年度报告置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

### 第二章 基金主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

本基金基金合同生效于2006年6月15日,本年度报告披露的数据和指标的计算期间为2006年6月15日至2006年12月31日。特此说明。

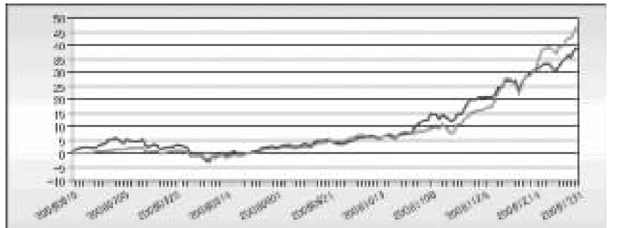
1.主要会计数据和财务指标

| 项 目 | 2006年 |
|---|---|
| 基金本期净收益 | 321,629,460.74元 |
| 基金份额本期净收益 | 0.1473元 |
| 期末可供分配基金份额收益 | 0.1789元 |
| 期末基金资产净值 | 2,267,283,557.67元 |
| 期末基金份额净值 | 1.4617元 |
| 本期基金份额净值增长率 | 46.17% |

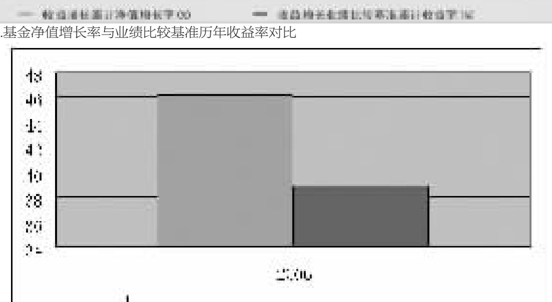
2.净值增长率与同期比较基准收益率比较

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去3个月 | 37.94% | 1.21% | 32.23% | 1.08% | 5.71% | 0.13% |
| 过去6个月 | 44.27% | 0.94% | 31.90% | 0.98% | 12.37% | –0.04% |
| 自基金合同生效至今 | 46.17% | 0.90% | 38.78% | 0.96% | 7.39% | –0.06% |

3.基金累计净值增长率与比较基准收益率走势对比



4.基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比



上图为本基金基金合同生效当年的净值收益率与业绩比较基准当年收益率的比较,基金净值收益率的计算期间为2006年6月15日(基金合同生效日)至2006年12月31日,特此说明。

5.基金历年收益分配情况

本基金自成立以来未进行分红。

本基金合同于2006年6月15日生效,截至报告日本基金合同生效未满一年。

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。

### 第三章 基金管理人报告

基金管理人是2003年3月7日正式成立的合资基金管理公司,截至本报告期末(2006年12月31日),所管理的开放式证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、本基金和先进成长基金,所管理的开放式证券投资基金资产净值合计18,676,924,519.27元。

1.基金经理简介

栾杰先生,上海财经大学研究生毕业。曾任海南港澳资讯产业有限公司研究员,华宝信托投资有限责任公司高级研究员,投资管理部副总经理。2003年初加入华宝兴业基金管理有限公司,任投资管理部总经理,同年7月起任宝康消费品基金经理,2006年6月起兼任本基金基金经理。

冯刚先生,管理学硕士,证券从业经历6年,曾在联合证券有限公司、华安基金管理公司、长城证券从事投资、研究、投资银行等工作。2004年3月加入华宝兴业基金管理有限公司,任高级研究员、多策略增长基金基金经理助理,2006年6月起任本基金基金经理。

2.基金遵规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

由于投资组合调整,收益增长基金在短期内出现过部分资产配置略低于基金相关内外部规定的情况。发生此类情况后,基金在合理期限内得到了调整,没有给投资人带来额外风险或损失。

3.基金经理报告

本基金于2006年6月中旬合同生效,基金管理人正式履行管理职责,截至报告期末,本基金在市场上涨过程中比较顺利地度过了建仓期。

在建仓期的头5个月,本基金考虑到要为持有人获得绝对回报、单位净值尽量保持在面值以上,采取了比较保守的投资策略,股票仓位相对较低。在顺利脱离面值后,鉴于经济基本面超出预期,再加上较充裕的流动性存在,股票仓位迅速上升,保持积极配置,对银行、地产、钢铁、商业尤其是各子行业龙头进行主要投资。截止到2006年12月底,本基金单位净值1.4617元,取得了比较好的投资业绩。

展望未来,通过我们投研团队的草根研究,发现中国经济的各行各业都出现了欣欣向荣的局面,而且股权分置改革后,上市公司高管都逐渐表现出对公司基本面具有很强的信心,这也有利于增强投资者对证券市场的信心。基金发行仍将方兴未艾,各种机构包括QFII、各种金融机构的集合理财计划、券商扩大自营规模、企业年金入市等等,随着人民币有限度升值,流动性泛滥的情况很难避免。因此,我们认为2007年股票市场总体上仍然乐观,企业基本面不断向好是股市将不断创出新高的坚实基础。但是,由于2007年面临小非解禁、宏观调控、估值提升过快和股票供给加大等因素,股票市场震荡将明显加大。

基于上述判断,本基金将在2007年总体上看多的前提下,采取相对积极的股票类资产配置。同时也会根据市场震荡加大的特征,注重结构性调整,努力通过寻找低估和挖掘高速成长的个股为基金争取超额收益。最近2个月市场也出现了一些震荡调整的走势,但我们的总体观点仍然不变,中国经济仍将一路走好,只不过证券市场有自身调整的需要、正处于休养生息的阶段,要用时间换空间。在经济向好和股改完成的背景下,有很多公司基本面或经营层的理念都发生了很大变化,因此,目前的市场相对平稳的阶段,对于价值投资者来说应该是很好的做研究的机会。本基金将坚持价值投资,下一阶段对行业、板块采取相对均衡的配置,关注每个子行业的龙头,尤其重视具备核心竞争力的民营企业,同时努力发掘被市场错误低估的个股。另外,我们也将关注优质资产注入和整体上市以及股权激励带来的投资机会。

### 第四章 托管人报告

中国建设银行股份有限公司根据《华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金合同》和《华宝兴业收益增长混合型证券投资基金托管协议》,托管华宝兴业收益增长混合型证券投资基金(以下简称收益增长基金)。

本报告期,中国建设银行股份有限公司在收益增长基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,依法安全保管了基金财产,按规定如实、独立地向中国证监会提交了本基金运作情况报告,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

本报告期,按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,本托管人对基金管理人–华宝兴业基金管理有限公司在收益增长基金投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人。基金管理人在合理期限内进行了调整,对基金份额持有人利益未造成损害。

由收益增长基金管理人–华宝兴业基金管理有限公司编制,并经本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

### 第五章 审计报告

本基金聘任的普华永道中天会计师事务所有限公司的注册会计师(汪棣、王灿)经过审计,于2007年3月21日对本基金出具了无保留意见的审计报告。审计报告文号为:普华永道中天审字(2007)第20187号。

### 第六章 财务会计报告

本基金成立于2006年6月15日,本年度报告报告期没有过往年度的同比期间,此报告仅披露本报告期的基金资产负债表、经营业绩及收益分配表、基金净值变动表。特此说明。

1. 基金资产负债表

金额单位:人民币元

| 资 产 | 2006年12月31日 |
|---|---|
| 银行存款 | 252,533,285.34 |
| 清算备付金 | 6,831,439.81 |
| 交易保证金 | 613,817.81 |
| 应收证券清算款 | 20,180,400.57 |
| 应收股利 | 0.00 |
| 应收利息 | 68,979.25 |
| 应收申购款 | 587,833.01 |
| 其他应收款 | 0.00 |
| 股票投资市值 | 1,984,947,972.99 |
| 其中:股票投资成本 | 1,459,055,558.48 |
| 债券投资市值 | 0.00 |
| 其中:债券投资成本 | 0.00 |
| 权证投资 | 50,107,826.11 |
| 其中:权证投资成本 | 41,219,885.85 |
| 买入返售证券 | 0.00 |
| 待摊费用 | 240,000.00 |
| 其他资产 | 0.00 |
| 资产合计 | 2,316,111,554.89 |
| 负债与持有人权益 | |
| 应付证券清算款 | 0.00 |
| 应付赎回款 | 41,228,424.02 |
| 应付赎回费 | 155,138.06 |
| 应付管理人报酬 | 2,848,017.47 |
| 应付托管费 | 474,669.59 |
| 应付佣金 | 3,334,153.18 |
| 应付利息 | 0.00 |
| 应付收益 | 0.00 |
| 未交税金 | 0.00 |
| 其他应付款 | 504,496.90 |
| 卖出回购证券款 | 0.00 |
| 短期借款 | 0.00 |
| 预提费用 | 283,098.00 |
| 其他负债 | 0.00 |
| 负债合计 | 48,827,997.22 |
| 实收基金 | 1,551,097,894.81 |
| 未实现利得 | 438,685,617.88 |
| 未分配收益 | 277,500,044.98 |
| 持有人权益合计 | 2,267,283,557.67 |
| 负债及持有人权益合计 | 2,316,111,554.89 |
| 期末基金份额净值 | 1.4617 |

2. 基金经营业绩及收益分配表

金额单位:人民币元

| 项目 | 2006年6月15日至2006年12月31日 |
|---|---|
| 一、已实现基金收入 | 345,048,444.89 |
| 其中:股票差价收入 | 323,238,023.36 |
| 债券差价收入 | –4,339,619.68 |
| 权证差价收入 | 12,403,485.91 |
| 债券利息收入 | 1,056,817.41 |
| 存款利息收入 | 4,471,243.97 |
| 股利收入 | 6,250,815.59 |
| 买入返售证券收入 | 482,465.75 |
| 其他收入 | 1,485,212.58 |
| 减:基金费用 | 23,418,984.15 |
| 其中:基金管理人报酬 | 19,197,886.80 |
| 基金托管费 | 3,199,647.74 |
| 卖出回购证券支出 | 702,025.27 |
| 利息支出 | 0.00 |
| 其他费用 | 319,424.34 |
| 其中:交易费用 | 0.00 |
| 信息披露费 | 173,098.00 |
| 审计费用 | 110,000.00 |
| 二、已实现基金收益 | 321,629,460.74 |
| 加:未实现利得 | 534,780,354.77 |
| 三、基金经营业绩 | 856,409,815.51 |
| 本期基金净收益 | 321,629,460.74 |
| 加:期初基金净收益 | 0.00 |
| 加:本期损益平准金 | –44,129,415.76 |
| 可供分配基金净收益 | 277,500,044.98 |
| 减:本期已分配基金净收益 | 0.00 |
| 期末基金净收益 | 277,500,044.98 |

3. 基金净值变动表

金额单位:人民币元

| 项目 | 2006年6月15日至2006年12月31日 |
|---|---|
| 一、期初基金净值 | 0.00 |
| 二、本期经营活动 | |
| 基金净收益 | 321,629,460.74 |
| 未实现利得 | 534,780,354.77 |
| 经营活动产生的基金净值变动数 | 856,409,815.51 |
| 三、本期基金单位交易 | |
| 基金申购款 | 2,599,136,903.68 |
| 基金赎回款 | 1,188,263,161.52 |
| 基金单位交易产生的基金净值变动数 | 1,410,873,742.16 |
| 四、本期向持有人分配收益 | |
| 向基金持有人分配收益产生金净值变动数 | 0.00 |
| 五、期末基金净值 | 2,267,283,557.67 |

4. 会计报表附注

(1)主要会计政策和会计估计

a. 会计报表编制基础

本基金的会计报表按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金合同》及中国证监会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

b. 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期会计报表的实际编制期间为2006年6月15日(基金合同生效日)至2006年12月31日。

c. 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

d. 记账基础和计价原则

本基金的记账基础为权责发生制。除股票投资、债券投资和权证投资按市值计价外,所有报表项目均以历史成本计价。

e. 基金资产的估值原则

(a)股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值;估值日无交易的,以最近交易日的市场交易收盘价估值。首次公开发行但未上市的股票,按成本估值;由于配股和非定向增发形成的暂时流通受限制的股票,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

(b)债券投资

证券交易所市场实行净价交易的国债按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值;估值日无交易的,以最近交易日的市场交易收盘价估值。证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值;估值日无交易的,以最近交易日的市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值。银行间同业市场交易的债券和未上市流通的债券按成本估值。

(c)权证投资

从获赠确认日、买入成交日或因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出日或行权日止,上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值;未上市交易的权证投资(包括配股权证)按公允价值估值。

(d)实际投资成本与估值的差异计入"未实现利得/(损失)"科目。

(e)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值,基金管理人应根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

f. 证券投资基金成本计价方法

(a)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资。股票投资成本按成交日应支付的全部价款入账。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价,于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

卖出股票于成交日确认股票差价收入/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(b)债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资;买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入账,其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,作为应收利息单独核算,不构成债券投资成本。认购新发行的分离交易可转债于成交日先按支付的全部价款确认为债券投资,后于权证实际取得日按附注(2)f(c)所示的方法单独核算权证成本,并相应调整债券投资成本。

买入贴息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,按上述会计处理方法核算。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入/(损失);卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(c)权证投资

获赠权证(包括配股权证)在确认日,按持有的股数及获赠比例计算并记录增加权证数量;买入权证于成交日确认为权证投资,相应成本按成交日应支付的全部价款入账。因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日,按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证成本。

卖出权证于成交日确认权证差价收入/(损失),出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

g. 待摊费用的摊销方法和摊销期限

核算本期已发生的、影响单位净值小数点后五位,应分摊计入本期和以后各期的费用,摊销期限为费用合同中约定的收益期限。

h. 收入的确认和计量

股票差价收入/(损失)于卖出股票成交日按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

证券交易所交易的债券差价收入/(损失)于卖出成交日确认;银行间同业市场交易的债券差价收入/(损失)于实际收到全部价款时确认。债券差价收入/(损失)按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

权证差价收入于卖出权证成交日按卖出权证成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

股利收入按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除息日确认。

买入返售证券收入按融出资金额及约定利率,在证券持有期内采用直线法逐日计提。

i. 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提。

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率,在回购期限内采用直线法逐日计提。

j. 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

k. 未实现利得/(损失)

未实现利得/(损失)包括因投资估值而产生的未实现估值增值/(减值)和未实现利得/(损失)平准金。

未实现利得/(损失)平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现利得/(损失)平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列。

l. 损益平准金

损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按未分配基金净收益/(累计基金净损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配基金净收益/(累计基金净损失)。

m. 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。基金收益分配每年至多六次,每次基金收益分配比例不低于可分配收益的50%。基金当期收益先弥补以前年度亏损后,方可进行当年收益分配。基金当年亏损,则不进行收益分配。基金收益分配后,基金份额净值不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

(2)重大关联方关系及关联交易

a. 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 华宝兴业基金管理有限公司 | 基金发起人、基金管理人、基金注册登记人、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司("中国建设银行") | 基金托管人、基金代销机构 |
| 华宝信托投资有限责任公司("华宝信托") | 基金管理人的股东 |
| 法国兴业资产管理有限公司 (Société Générale Asset Management SA) | 基金管理人的股东 |
| 上海宝钢集团公司("宝钢集团") | 基金管理人的股东的母公司 |

b. 关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(a)基金管理人报酬

支付基金管理人华宝兴业基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值X1.5%/当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬19,197,886.80元。

(b)基金托管费

支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金托管费=前一日基金资产净值X0.25%/当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金托管费3,199,647.74元。

(c)与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易

本基金本报告期没有与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

(d)由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。基金托管人于2006年12月31日保管的银行存款余额为252,533,285.34元。本会计期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为4,432,474.08元。

(e)关联方持有的基金份额

| | 2006年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 基金份额(份) | 净值(元) | 占基金总份额的比例 |
| 宝钢集团 | 150,021,000.00 | 219,285,695.70 | 9.67% |

(f)基金管理人持有的基金份额

基金管理人在本报告期内未对本基金进行投资。

(3)流通受限制不能自由转让的基金资产

a. 本基金截至2006年12月31日止持有以下因股权分置改革而暂时停牌的股票,这些股票将在上市公司完成与流通股股东的沟通协商程序后或在股权分置改革规定的程序结束后复牌。

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 年末估值单价(元) | 复牌日期 | 复牌开盘单价(元) | 数量(股) | 年末成本总额(元) | 年末估值总额(元) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 方案沟通协商阶段停牌: | | | | | | | | |
| 000965 | S天水 | 06/12/22 | 8.83 | 07/01/05 | 9.60 | 100,000 | 750,925.55 | 883,000.00 |
| 方案实施段停牌: | | | | | | | | |
| 600290 | S苏福马 | 06/12/15 | 15.47 | 07/02/01 | 22.01 | 1,239,151 | 11,858,908.59 | 19,169,665.97 |
| 600582 | S天地 | 06/12/14 | 24.94 | 07/01/15 | 30.00 | 1,565,700 | 36,048,103.84 | 39,048,558.00 |
| 600737 | S*ST屯河 | 06/12/22 | 7.53 | 07/01/23 | 9.88 | 700,000 | 5,439,206.03 | 5,271,000.00 |
| 合计 | | | | | | | 54,097,144.01 | 64,372,223.97 |

b. 基金可使用以基金名义开设的股票账户,比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股或增发新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

本基金截至2006年12月31日止投资的流通受限制的股票情况如下:

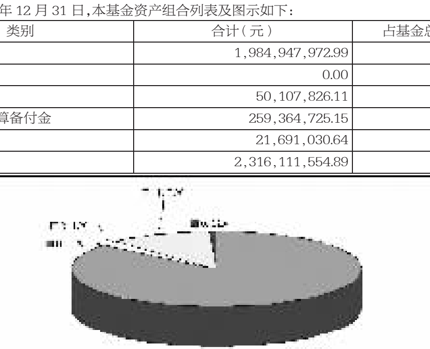
| 股票代码 | 股票名称 | 成功申购日期 | 可流通日期 | 申购价格(元) | 年末估值单价(元) | 数量(股) | 年末成本总额(元) | 年末估值总额(元) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 601398 | 工商银行 | 06/10/23 | 07/01/29 | 3.12 | 6.20 | 8,413,000 | 26,248,560.00 | 52,160,600.00 |
| 601006 | 大秦铁路 | 06/07/26 | 07/02/01 | 4.95 | 8.10 | 3,719,600 | 18,412,020.00 | 30,128,760.00 |
| 601588 | 北辰实业 | 06/09/28 | 07/01/16 | 2.40 | 6.68 | 2,157,090 | 5,177,016.00 | 14,409,361.20 |
| 601628 | 中国人寿 | 06/12/28 | 07/04/09 | 18.88 | 18.88 | 282,240 | 5,328,691.20 | 5,328,691.20 |
| 601991 | 大唐发电 | 06/12/12 | 07/03/20 | 6.68 | 10.32 | 243,000 | 1,623,240.00 | 2,507,760.00 |
| 002075 | 高新张铜 | 06/10/12 | 07/01/25 | 4.25 | 9.46 | 159,378 | 677,356.50 | 1,507,715.88 |
| 002073 | 青岛软控 | 06/09/28 | 07/01/18 | 26.00 | 47.35 | 29,813 | 775,138.00 | 1,411,645.55 |
| 002106 | 莱宝高科 | 06/12/27 | 07/04/12 | 20.00 | 20.00 | 56,031 | 1,120,620.00 | 1,120,620.00 |
| 002088 | 鲁阳股份 | 06/11/21 | 07/02/28 | 11.00 | 26.98 | 38,917 | 428,087.00 | 1,049,980.66 |
| 002095 | 网盛科技 | 06/12/06 | 07/03/15 | 14.09 | 55.12 | 17,772 | 250,407.48 | 979,592.64 |
| 002072 | 德棉股份 | 06/09/22 | 07/01/18 | 3.24 | 5.05 | 187,094 | 606,184.56 | 944,824.70 |
| 002097 | 山河智能 | 06/12/12 | 07/03/22 | 10.00 | 32.41 | 27,349 | 273,490.00 | 886,381.09 |
| 002081 | 金螳螂 | 06/11/06 | 07/02/26 | 12.80 | 24.00 | 36,846 | 471,628.80 | 884,304.00 |
| 600017 | 日照港 | 06/09/28 | 07/01/18 | 4.70 | 7.22 | 111,017 | 521,779.90 | 801,542.74 |
| 002070 | 众和股份 | 06/09/20 | 07/01/12 | 8.84 | 13.80 | 53,328 | 471,419.52 | 735,926.40 |
| 002071 | 江苏宏宝 | 06/09/21 | 07/01/12 | 3.88 | 7.01 | 102,417 | 397,377.96 | 717,943.17 |
| 002101 | N鸿图 | 06/12/20 | 07/03/29 | 11.41 | 19.30 | 34,425 | 392,789.25 | 664,402.50 |
| 002102 | N冠福 | 06/12/20 | 07/03/29 | 5.96 | 11.18 | 58,384 | 347,968.64 | 652,733.12 |
| 002076 | 雪莱特 | 06/10/12 | 07/01/25 | 6.86 | 18.77 | 32,558 | 223,347.88 | 611,113.66 |
| 601333 | 广深铁路 | 06/12/18 | 07/03/22 | 3.76 | 7.20 | 84,540 | 317,870.40 | 608,688.00 |
| 002090 | 金智科技 | 06/11/28 | 07/03/08 | 14.20 | 22.25 | 27,174 | 385,870.80 | 604,621.50 |
| 002074 | 东源电器 | 06/09/27 | 07/01/18 | 7.88 | 14.11 | 42,423 | 334,293.24 | 598,588.53 |
| 002079 | 苏州固锝 | 06/11/01 | 07/02/16 | 6.39 | 10.28 | 53,560 | 342,248.40 | 550,596.80 |
| 002080 | 中材科技 | 06/11/07 | 07/02/26 | 8.98 | 19.40 | 21,965 | 197,245.70 | 426,121.00 |
| 601628 | 中国人寿 | 06/12/28 | 07/01/09 | 18.88 | 18.88 | 6,000 | 113,280.00 | 113,280.00 |
| 合计 | | | | | | | 65,437,931.23 | 120,405,794.34 |

### 第七章 投资组合报告

1. 基金资产组合

截至2006年12月31日,本基金资产组合列表及图示如下:

| 类别 | 合计(元) | 占基金总资产比例 |
|---|---|---|
| 股票投资 | 1,984,947,972.99 | 85.70% |
| 债券投资 | 0.00 | 0.00% |
| 权证投资 | 50,107,826.11 | 2.16% |
| 银行存款及清算备付金 | 259,364,725.15 | 11.20% |
| 其它资产 | 21,691,030.64 | 0.94% |
| 合计 | 2,316,111,554.89 | 100.00% |



2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 序号 | 分类 | 市值(元) | 占净值比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 农、林、牧、渔业 | 37,765,730.88 | 1.67% |
| 2 | 采掘业 | 69,060,200.00 | 3.05% |
| 3 | 制造业 | 918,292,042.30 | 40.50% |
| | 其中:食品、饮料 | 168,209,443.85 | 7.42% |
| | 纺织、服装、皮毛 | 1,680,751.10 | 0.07% |
| | 石油、化学、塑胶、塑料 | 161,249,782.34 | 7.11% |
| | 电子 | 8,661,766.26 | 0.38% |
| | 金属、非金属 | 323,364,968.00 | 14.26% |
| | 机械、设备、仪表 | 185,849,791.60 | 8.20% |
| | 医药、生物制品 | 69,275,539.15 | 3.06% |
| 4 | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 50,248,757.53 | 2.22% |
| 5 | 建筑业 | 11,866,304.00 | 0.52% |
| 6 | 交通运输、仓储业 | 133,215,339.74 | 5.88% |
| 7 | 信息技术业 | 22,769,114.14 | 1.00% |
| 8 | 批发和零售贸易 | 151,919,603.54 | 6.70% |
| 9 | 金融、保险业 | 311,807,687.60 | 13.75% |
| 10 | 房地产业 | 136,751,955.36 | 6.03% |
| 11 | 社会服务业 | 3,707,584.50 | 0.16% |
| 13 | 综合类 | 137,543,653.40 | 6.07% |
| | 合计 | 1,984,947,972.99 | 87.55% |

3. 报告期末基金投资股票前十名明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 股票数量(股) | 期末市值(元) | 市值占基金净值比例 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600036 | 招商银行 | 7,600,000 | 124,336,000.00 | 5.4839% |
| 2 | 600809 | 山西汾酒 | 2,891,855 | 89,618,586.45 | 3.9527% |
| 3 | 600000 | 浦发银行 | 3,850,000 | 82,043,500.00 | 3.6186% |
| 4 | 600005 | 武钢股份 | 11,476,700 | 72,991,812.00 | 3.2194% |
| 5 | 000709 | 唐钢股份 | 11,600,000 | 64,960,000.00 | 2.8651% |
| 6 | 600415 | 小商品城 | 830,000 | 64,325,000.00 | 2.8371% |
| 7 | 600048 | 保利地产 | 1,363,938 | 59,085,794.16 | 2.6060% |
| 8 | 600309 | 烟台万华 | 2,250,000 | 54,517,500.00 | 2.4045% |
| 9 | 601398 | 工商银行 | 8,500,000 | 52,700,000.00 | 2.3244% |
| 10 | 600900 | 长江电力 | 4,886,489 | 47,740,997.53 | 2.1056% |

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于www.fsfund.com网站的年度报告正文。

4 报告期内股票投资组合重大变动

(1)累计买入重大变动

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额(元) | 本期累计买入占期末基金资产净值比例 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600036 | 招商银行 | 105,091,627.89 | 4.64% |
| 2 | 600000 | 浦发银行 | 80,991,097.69 | 3.57% |
| 3 | 600005 | 武钢股份 | 76,147,335.63 | 3.36% |
| 4 | 600887 | 伊利股份 | 76,134,437.75 | 3.36% |
| 5 | 600016 | 民生银行 | 75,610,137.44 | 3.33% |
| 6 | 601398 | 工商银行 | 75,370,670.15 | 3.32% |
| 7 | 600048 | 保利地产 | 73,356,692.68 | 3.24% |
| 8 | 600009 | 上海机场 | 67,858,155.61 | 2.99% |
| 9 | 600895 | 张江高科 | 66,612,751.05 | 2.94% |
| 10 | 600900 | 长江电力 | 62,921,284.54 | 2.78% |
| 11 | 600415 | 小商品城 | 62,864,305.70 | 2.77% |
| 12 | 000792 | 盐湖钾肥 | 58,636,302.04 | 2.59% |
| 13 | 600028 | 中国石化 | 58,591,602.27 | 2.58% |
| 14 | 601006 | 大秦铁路 | 58,341,316.05 | 2.57% |
| 15 | 000858 | 五粮液 | 58,321,202.35 | 2.57% |
| 16 | 000709 | 唐钢股份 | 56,216,160.36 | 2.48% |
| 17 | 600809 | 山西汾酒 | 54,951,956.49 | 2.42% |
| 18 | 600026 | 中海发展 | 53,357,520.94 | 2.35% |
| 19 | 000825 | 太钢不锈 | 53,284,423.26 | 2.35% |
| 20 | 000039 | 中集集团 | 50,439,363.79 | 2.22% |
| 21 | 600309 | 烟台万华 | 50,022,844.62 | 2.21% |
| 22 | 600219 | 南山铝业 | 48,927,518.13 | 2.16% |
| 23 | 600500 | 中化国际 | 47,973,881.44 | 2.12% |
| 24 | 600879 | 火箭股份 | 46,369,410.73 | 2.05% |

(2)累计卖出重大变动

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额(元) | 本期累计卖出占期末基金资产净值比例 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600016 | 民生银行 | 82,494,029.33 | 3.64% |
| 2 | 600028 | 中国石化 | 63,119,412.88 | 2.78% |
| 3 | 600895 | 张江高科 | 62,332,029.41 | 2.75% |
| 4 | 000858 | 五粮液 | 59,973,975.74 | 2.65% |
| 5 | 000825 | 太钢不锈 | 57,934,523.01 | 2.56% |
| 6 | 601398 | 工商银行 | 57,796,107.14 | 2.55% |
| 7 | 600887 | 伊利股份 | 57,786,393.11 | 2.55% |
| 8 | 600036 | 招商银行 | 52,422,577.87 | 2.31% |
| 9 | 600005 | 武钢股份 | 52,231,118.13 | 2.30% |
| 10 | 000069 | 华侨城A | 52,053,002.25 | 2.30% |
| 11 | 600500 | 中化国际 | 50,964,419.26 | 2.25% |
| 12 | 601006 | 大秦铁路 | 49,856,769.83 | 2.20% |
| 13 | 600050 | 中国联通 | 48,725,581.35 | 2.15% |
| 14 | 000528 | 柳　工 | 48,662,222.02 | 2.15% |
| 15 | 600026 | 中海发展 | 42,145,934.72 | 1.86% |
| 16 | 601988 | 中国银行 | 41,965,914.84 | 1.85% |
| 17 | 000402 | 金融街 | 41,521,092.90 | 1.83% |
| 18 | 600048 | 保利地产 | 40,888,201.80 | 1.80% |
| 19 | 600009 | 上海机场 | 38,609,890.52 | 1.70% |
| 20 | 600880 | 博瑞传播 | 31,778,343.14 | 1.40% |

(3)报告期买入股票成本及卖出股票收入

| 本期买入股票成本总额 | 本期卖出股票收入总额 |
|---|---|
| 3,839,552,582.29元 | 2,703,353,686.79元 |

5. 报告期末按券种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券种类 | 市值(元) | 占净值比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 0.00 | 0.0000% |
| 2 | 金融债券 | 0.00 | 0.0000% |
| 3 | 企业债券 | 0.00 | 0.0000% |
| 4 | 可转换债券 | 0.00 | 0.0000% |
| 合计 | | 0.00 | 0.0000% |

6. 报告期末基金债券投资前五名明细

本报告期末本基金债券投资市值为0.00元。

7. 基金资产支持证券投资前十名明细

本基金本报告期内未发生资产支持证券投资,特此报告。

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10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10名股票投资没有超出基金合同规定的股票备选库。

(3)本基金投资组合中其他资产包括:交易保证金613,817.81元、证券清算款20,180,400.57元、应收利息68,979.25元、应收申购款587,833.01元、待摊费用240,000.00元。

(4)本基金未持有在转股期内的可转换债券。

(5)本基金在本报告期内持有的权证明细如下:

a. 股权分置改革被动持有:

| 权证代码 | 权证名称 | 数量(份) | 成本(元) | 期末市值(元) |
|---|---|---|---|---|
| 580009 | 伊利CWB1 | 495,000.00 | 0.00 | 0.00 |

b.主动投资

| 权证代码 | 权证名称 | 数量(份) | 成本(元) | 期末市值(元) |
|---|---|---|---|---|
| 580011 | 中化CWB1 | 1,182,300.00 | 1,721,192.34 | 0.00 |
| 031002 | 钢钒GFC1 | 2,211,000.00 | 1,740,057.00 | 0.00 |
| 580001 | 武钢JTB1 | 2,500,000.00 | 1,248,130.12 | 0.00 |
| 580005 | 万华HXB1 | 235,001.00 | 4,228,644.50 | 5,231,357.26 |
| 580009 | 伊利CWB1 | 280,000.00 | 4,890,930.61 | 4,948,440.00 |
| 030002 | 五粮YGC1 | 1,250,000.00 | 12,984,412.90 | 18,125,000.00 |
| 031001 | 侨城HQC1 | 1,551,817.00 | 19,115,897.84 | 21,803,028.85 |
| 总计 | | 9,210,118.00 | 45,929,265.31 | 50,107,826.11 |

(6)基金管理人在本报告期内未发生运用自有资金投资本基金的行为。

### 第八章 基金份额持有人户数、持有人结构

本基金报告期末持有人户数及持有人结构列表如下:

| 基金名称 | 总持有人户数(户) | 持有人户均持有基金份额(份) | 机构投资人持有份额(份) | 个人投资人持有份额(份) | 机构投资人持有份额比例 | 个人投资人持有份额比例 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 华宝兴业收益增长混合型证券投资基金 | 33292 | 46,590.71 | 496,398,697.60 | 1,054,699,197.21 | 32.00% | 68.00% |

### 第九章 基金份额变动情况

1. 基金合同生效日基金总份额

单位:份

| 基金 | 基金合同生效日基金总份额 |
|---|---|
| 华宝兴业收益增长基金 | 2,339,809,854.34 |

2. 本基金在报告期内基金份额的变动情况列表如下:

单位:份

| 基金名称 | 期初基金份额总额 | 期末基金份额总额 | 期间总申购份额(包括转入份额) | 期间总赎回份额(包括转出份额) |
|---|---|---|---|---|
| 华宝兴业收益增长基金 | 2,339,809,854.34 | 1,551,097,894.81 | 231,811,491.18 | 1,020,523,450.71 |

### 第十章 重大事件揭示

1. 报告期内本系列基金未召开基金份额持有人大会。

2. 报告期内本系列基金的基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

3. 报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

4. 2006年7月27日,中国建设银行股份有限公司董事会召开会议,通过了委任张建国先生担任中国建设银行行长的议案;2006年10月20日,中国建设银行股份有限公司举行2006年第一次临时股东大会,委任张建国先生为建行执行董事,同时出任副董事长。2006年7月,常振明先生辞任建行副董事长、执行董事及行长的职务。

5. 2006年12月28日,中国建设银行股份有限公司根据工作需要,将"基金托管部"更名为"投资托管服务部"。

6. 本系列基金的投资策略在报告期内未发生变更。

7. 本系列基金在报告期内未进行收益分配。

8. 根据基金管理人与中信建投证券有限责任公司(以下简称"中信建投")、华夏证券股份有限公司(以下简称"华夏证券")签署的合同变更协议书,自2006年1月18日起,中信建投作为华夏证券证券业务的继承人,所有原华夏证券与基金管理人签订的代销协议中应由华夏证券享有和承担的权利义务,均变更为由中信建投享有和承担,华夏证券不再享有和承担原代销协议规定的任何权利义务。中信建投承受华夏证券基金代销业务已获中国证监会证监基金字[2005]207号文批准。

基金管理人已于2006年1月18日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。

9. 根据基金管理人与平安证券有限责任公司签署的《证券投资基金销售代理协议》,平安证券有限责任公司自2006年5月24日起代理销售本基金。

基金管理人已于2006年5月24日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。

10.为维护基金份额持有人的利益,回报广大持有人对基金管理人的支持与厚爱,基金管理人于2006年9月11日到2006年10月18日期间开展基金优惠申购费率活动,涉及基金包括宝康系列基金、多策略基金、华宝兴业动力组合基金、华宝兴业现金宝货币市场基金、本基金。

基金管理人已于2006年9月6日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。

11.为方便个人投资者通过网上交易方式投资基金管理人所管理的开放式基金,基金管理人与广东发展银行合作,于2006年10月27日起面向持有广发银行理财通卡的个人投资者推出基金网上交易业务,适用基金管理人所管理的所有开放式基金。

基金管理人已于2006年10月25日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。

12.为方便个人投资者通过网上交易方式投资基金管理人所管理的开放式基金,基金管理人与中国建设银行合作,于2006年12月6日起面向持有建设银行龙卡的个人投资者推出了基金网上交易业务,适用基金管理人所管理的所有开放式基金。

基金管理人已于2006年12月4日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。

13.根据基金管理人与东方证券股份有限公司签署的《证券投资基金销售代理协议》,东方证券自2006年12月25日起代理销售基金管理人所管理的宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合股票型证券投资基金和本基金。

基金管理人已于2006年12月20日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。

14.根据基金管理人与中信证券股份有限公司签署的《证券投资基金销售代理协议》,中信证券自2006年12月25日起代理销售基金管理人所管理的宝康系列基金、现金宝货币市场基金、动力组合股票型证券投资基金和本基金。

基金管理人已于2006年12月22日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。

15.基金管理人为本基金聘任的会计师事务所在本报告期的审计报酬为110,000.00元人民币。目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为:本基金合同生效之日(2006年6月15日)起至本报告期末。

16.本基金租用交易席位情况

报告期内,本基金共租用银河证券、光大证券、申银万国、中信证券和广发证券等5个交易专用席位。报告期内租用券商专用席位无变更,各券商专用席位交易和佣金情况如下:

(1)华宝兴业收益增长基金2006年度股票交易量和实付佣金情况如下:

| 序号 | 券商名称 | 股票交易量(元) | 占总交易量比例(%) | 佣金(元) | 占佣金总量比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 光大证券 | 1,268,630,308.24 | 20.04 | 992,713.50 | 19.38 |
| 2 | 申银万国 | 1,575,933,721.84 | 24.89 | 1,292,259.15 | 25.22 |
| 3 | 中信证券 | 2,330,568,432.71 | 36.81 | 1,911,054.77 | 37.30 |
| 4 | 银河证券 | 548,700,571.66 | 8.67 | 429,362.12 | 8.38 |
| 5 | 广发证券 | 607,537,646.77 | 9.60 | 498,179.07 | 9.72 |
| 合计 | | 6,331,370,681.22 | 100.00 | 5,123,568.61 | 100.00 |

(2)华宝兴业收益增长基金2006年度债券和国债回购交易量情况如下:

| 序号 | 券商代码 | 债券交易量(元) | 占交易量比例(%) | 回购交易量(元) | 占交易量比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 光大证券 | 7,428,502.00 | 34.22 | 0.00 | 0.00 |
| 2 | 申银万国 | 3,090,851.90 | 14.24 | 0.00 | 0.00 |
| 3 | 中信证券 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 4 | 银河证券 | 2,645,540.80 | 12.19 | 0.00 | 0.00 |
| 5 | 广发证券 | 8,542,946.20 | 39.35 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | | 21,707,840.90 | 100.00 | 0.00 | 0.00 |

(3)基金管理人选择专用席位的标准和程序如下:

a.选择标准:资力雄厚,信誉良好,注册资本不少于5亿元人民币;财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;经营行为规范,最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚;内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务;研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为本基金提供高质量的咨询服务,并能根据基金投资的特定要求,提供专门研究报告;适当的地域分散化。

b.选择程序:(a)服务评价;(b)拟定备选专用席位;(c)签约。

**华宝兴业基金管理有限公司**
**2007年3月31日**