华宝兴业先进成长股票型证券投资基金

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2007年5月31日;有关财务数据和净值表现截止日为2007年3月31日,财务数据未经审计。

一、《基金合同》生效日期

本基金自2006年10月12日到2006年11月3日向个人投资者和机构投资者同时发售,《基金合同》于2006年11月7日生效。

二、基金管理人

(一) 基金管理人概况

基金管理人: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:021－50499588
联系人:林志宗

股权结构:中方股东华宝信托投资有限责任公司持有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、 基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

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。

王晓薇女士,董事,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裁。

袁志刚先生,独立董事,博士、教授、博导。法国巴黎社会科学高等研究院(E.H.E.S.S.)经济学博士毕业,曾任复旦大学经济学院副教授、教授、经济系系主任。现任复旦大学经济学院院长。

Christian CLERC–BATUT先生,独立董事,商学本科。曾任S. N. S. 阿尔及利亚子公司总会计师、欧尚集团存货部总监、芝加哥子公司总经理、审计部总审计师。现任欧尚集团中国及泰国区总经理。

谢荣先生,独立董事,博士、教授。曾任上海财经大学助教、讲师、副教授、教授,毕马威华振会计师事务所合伙人。现任上海国家会计学院副院长。

吴志攀先生,独立董事,法学博士、教授。曾任北京大学法律系讲师、副教授、教授、博导,经济法教研室副主任、系主任,北京大学法学院院长,北京大学校长助理。现任北京大学副校长。

裴长江先生,董事总经理,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。

陆云飞(Denis LEFRANC)先生,董事副总经理,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。现任华宝兴业基金管理有限公司董事副总经理。

陆舜华女士,监事、监事会召集人,现任法兴资产(香港)首席执行官。

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。

詹靖女士,监事,金融学硕士,曾在TCL销售公司人力资源部、华宝信托投资有限责任公司业务管理部、基金筹备组、华宝兴业基金管理有限公司投资管理部工作,现在公司人力资源部工作。

2、 本基金基金经理

魏东先生,经济学硕士,证券从业经历10年。曾在平安证券公司和国信证券公司从事证券研究、证券交易和资产管理工作,2003年3月至2004年5月在本公司任交易部总经理,2004年5月起任宝康灵活配置基金基金经理。2007年2月起担任本公司投资副总监。

3、 投资决策委员会成员

余荣权先生,投资总监。

栾杰先生,投资副总监,投资部总经理,宝康消费品基金基金经理,收益增长基金基金经理。

Gabriel Gondard先生,投资副总监。

魏东先生,投资副总监,宝康灵活配置基金基金经理、先进成长基金基金经理。

王旭巍先生,宝康债券基金基金经理。

雷勇先生,研究部总经理。

牟旭东先生,研究部副总经理。

(三)基金管理人职责

基金管理人应严格依法履行下列职责:

1、依法募集本基金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
2、办理本基金备案手续;
3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账,进行证券投资;
4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;
5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
6、编制中期和年度基金报告;
7、计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;
8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项;
9、召集基金份额持有人大会;
10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
11、以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
12、中国证监会规定的其他职责。

(四)基金管理人承诺

1、 基金管理人将遵守《基金法》、《证券法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的相关规定,并建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违法违规行为的发生。

2、 基金管理人不从事下列行为:
(1)将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;
(2)不公平地对待其管理的不同基金财产;
(3)利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;
(4)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;
(5)依照法律、行政法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、 基金经理承诺
(1)依照有关法律法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;
(2)不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益;
(3)不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;
(4)不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(五)基金管理人内部控制制度

1、风险管理体系

本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,保证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、市场开发等相关部门,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)基金托管人基本情况

本基金之基金托管人为中国银行股份有限公司(简称"中国银行"),基本情况如下:

住所:北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:肖 钢
企业类型:股份有限公司
注册资本:人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元
存续期间:持续经营
成立日期:1983年10月31日
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24号
托管部门总经理:秦立儒
托管部门联系人:宁敏
电话:(010)66594977
传真:(010)66594942

发展概况:

中国银行业务覆盖传统商业银行、投资银行和保险领域,并在全球范围内为个人客户和公司客户提供全面和优质的金融服务,截至2006年底,在世界27个国家和地区拥有分支机构,与1500家国外代理行及47000家分支机构保持了代理业务关系,凭借全球化的网络及其优质的服务、雄厚的实力,本行在国内市场保持着独特的竞争优势。

在近百年的岁月里,中国银行以其稳健的经营、雄厚的实力、成熟的产品和丰富的经验深得广大客户信赖,打造了卓越的品牌,与客户建立了长期稳固的合作关系。

中国银行主营商业银行业务,包括公司业务、个人金融业务和资金业务。中国银行向公司客户提供包括贷款、票据贴现、贸易融资、存款、结算、清算、现金管理等各项金融产品和度身定制的财务综合解决方案。中国银行为个人客户提供一系列个人或家庭银行产品及服务,包括储蓄存款、消费信贷、支付结算、银行卡和财富管理等。在多年的发展历程中,中国银行曾创造了中国银行业的许多第一,所创新和研发的一系列金融产品与服务均开创历史之先河,在业界独领风骚,享有盛誉。目前在外汇存贷款、国际结算、外汇资金和贸易融资等领域居于领先地位,且保持了持续快速增长。截至2006年底,中国银行境内外分支机构共有11,241家,其中境内拥有37家一级分行、直属分行,283家二级分行及10277家分支机构,境外分支机构643家分行、子公司及代表处,是中国国际化程度最高的银行。中国银行在国内同业中率先引进国际管理技术人才和经营理念,不断向国际化一流大银行的目标迈进。

中国银行有近百年辉煌而悠久的历史, 在中国金融史上扮演了十分重要的角色。中国银行于1912年由孙中山先生批准成立,至1949年中华人民共和国成立的37年间,中国银行先后是当时的国家中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行。在动荡的历史年代,中国银行作为民族金融的支柱,以服务大众、振兴民族金融业为己任,稳健经营,锐意进取,各项业务取得了长足发展。

新中国成立后,中国银行成为国家指定的外汇外贸专业银行,继续保持和发扬了顽强创业的企业精神,为国家对外经贸发展、开展经济建设作出了贡献。1994年随着金融体制改革的深化,中国银行由外汇外贸专业银行向功能完善、服务全面的国有商业银行转化,与其它三家国有商业银行一道成为国家金融业的支柱。1994年和1995年,中国银行先后成为香港地区、澳门地区发钞银行。为提高竞争优势,中国银行从2000年初开始围绕建立良好的公司治理机制采取了一系列的改革。2001年,中国银行成功重组了香港中银集团,将10家成员银行合并成当地注册的"中国银行(香港)有限公司"。2002年7月,重组后的中国银行(香港)有限公司在香港联交所成功上市, 成为国内首家在境外上市的国有商业银行。2004年7月14日,中国银行在与国际同业和国内同业的激烈竞争中,凭借雄厚的实力和优良的服务,脱颖而出,作为我国银行业的优秀代表携手北京2008年奥运会,成为北京奥运会唯一的银行合作伙伴。

中国银行于2003年被国务院确定为国有独资商业银行股份制改造试点银行,围绕"资本充足、内控严密、运营安全、服务和效益良好、具有国际竞争力的现代化股份制商业银行"的目标,进一步完善符合现代企业制度要求的公司治理机制, 稳步推进国有商业银行的股份制改造工作。2004年8月26日,中国银行股份有限公司成立,中国银行成为国家控股的股份制商业银行,标志着中国银行向建立良好公司治理机制的现代化股份制商业银行的目标迈进了一大步,中国银行的历史翻开了新的一页。

2006年6月1日,中国银行在香港联交所成功挂牌上市,共集资754.27亿港元。继成功发行H股并上市之后,2006年7月5日,中国银行在上海证券交易所成功发行A股,是中国资本市场第一家国有商业银行股,是全流通背景下的第一家"海归"股。在国际和国内资本市场同时上市,进一步提高了资本实力,中国银行进入了一个新的发展时期。在势如破竹的中国金融银行业改革的大潮中,在"新兴+转轨"的中国资本市场改革的大趋势中,中国银行将健康、快速、持续发展,创造更新的辉煌、谱写更绚丽的篇章!

中国银行多年来围绕客户需求所做的不懈努力,得到了来自业界、客户和权威第三方的广泛认可。从1990年以来,中国银行一直荣登《财富》500强排行榜,并被《财富》(中文版)评选为2006年最受赞赏的中国公司;自1992年,中国银行八次被《欧洲货币》杂志评为"中国最佳银行"或"中国最佳本地银行",并于2005年被《欧洲货币》评为中国及香港 "最佳商业银行"(2005年房地产奖项);2004至2006年,中国银行连续三年被《环球金融》杂志评为"中国最佳贸易融资银行"和"中国最佳外汇银行";在中央电视台和《销售与市场》杂志共同主办的"2005中国营销盛典"中,被评为"2005年度中国企业营销创新奖"(是获奖企业中唯一的金融企业);根据英国《金融时报》2005年8月进行的调查,中国银行是中国的十大国际品牌之一;另外,中国银行被国家工商总局授予"中国驰名商标"。2006年在《银行家》杂志"世界1000家大银行"中排名第17位,被《财资》杂志评为2006年度AAA奖项中国地区最佳现金管理银行、中国地区最佳贸易融资银行,同时《亚洲货币》杂志也将中国银行评为"中国最佳现金管理银行";被《新兴市场》杂志评为"2006年亚洲地区年度最佳银行",被《亚洲风险》杂志评为"2006年度中国最佳银行";获得了《亚洲法律事务》杂志2006年"银行和财经服务公司法务组大奖",是国内唯一获得该奖项的金融机构;被《投资者关系》杂志评选为"中国市场企业交易最佳投资者关系"、"香港市场IPO最佳投资者关系";在第十四届中国国际金融(银行)技术暨设备展览会上,本行的产品获得"金融业务创新奖";此外,积极推进企业文化建设,营造诚信、绩效、责任、创新、和谐的氛围,于2005年,被《中国人才》(《China Staff》)授予"中国大陆'最佳人力资源战略奖'",这是大中华区人力资源管理领域的最高评奖;2006年再次荣获"优信咨询(Universum)"评选的"大学生心目中最理想雇主奖"。

世纪信誉,环球共享。中国银行将秉承"以客户为中心,以市场为导向,强化公司治理,追求卓越效益,创建国际一流大银行"的宗旨,依托其雄厚的实力、遍布全球的分支机构、成熟的产品和丰富的经验,竭诚为客户提供全方位、高品质的银行服务,与广大客户携手共创美好未来。

财务概况:

2006年,中国银行资产总额53252.73亿元人民币,股东权益(不含少数股东权益)合计3882.54亿元人民币,分别比上年增长12.28%和66.03%,实现净利润418.92亿元人民币,比上年增长52.38%,总资产回报率和权益净回报率分别达到0.94%和13.86%,同比提高0.22个百分点和0.70个百分点;资产质量持续改善,2006年末不良贷款比率从2005年末的4.62%进一步下降到4.04%, 下降0.58个百分点,资本充足率为13.59%,核心资本充足率为11.44%,分别较上年增加3.17个百分点及3.36个百分点。

(二)主要人员情况

肖钢先生,自2004年8月起任中国银行股份有限公司董事长、党委书记。自2003年3月起任中国银行董事长、党委书记、行长,自1996年10月起任中国人民银行行长助理,期间曾兼任中国人民银行计划资金司司长、货币政策司司长、广东省分行行长及国家外汇管理局广东省分局局长。1989年10月至1996年10月,历任中国人民银行政策研究室副主任、主任、中国外汇交易中心总裁、计划资金司司长等职。肖先生出生于1958年8月,1981年毕业于湖南财经学院,1996年获得中国人民大学法学硕士学位。

李礼辉先生,自2004年8月起担任中国银行股份有限公司副董事长、党委副书记、行长。2002年9月至2004年8月担任海南省副省长。1994年7月至2002年9月担任中国工商银行副行长。1988年至1994年7月历任中国工商银行国际业务部总经理、新加坡代表处首席代表、福建省分行副行长等职。李先生出生于1952年5月,1977年毕业于厦门大学经济系财政金融专业,1999年获得北京大学光华管理学院金融学专业博士研究生学历和经济学博士学位。

王永利先生,自2006年8月起担任中国银行股份有限公司副行长。自2004年8月起任中国银行股份有限公司行长助理,自2003年11月起任中国银行副行长。1997年4月至2003年11月历任中国银行财务部、资产负债管理部副总经理、总经理、福建省分行常务副行长及行长,以及河北省分行行长等职。王先生出生于1964年4月,1987年毕业于中国人民大学,2005年获得厦门大学博士学位。

秦立儒先生,自2005年10月起担任中国银行股份有限公司托管及投资者服务部总经理。2005年5月至2005年10月任中国银行股份有限公司托管及投资者服务部负责人。2004年4月至2005年5月任中国银行股份有限公司全球金融市场部总经理。2002年7月至2004年4月任中国银行(香港)有限公司资金部总经理;1999年6月至2002年7月任香港中银集团外汇交易中心总经理;1997年9月至1999年6月任广东省银行香港分行(香港中银集团)总经理;1995年11月至1997年9月任中国银行总行资金部副总经理, 主管全球资金交易;1991年5月至1995年11月历任中国银行纽约分行资金部经理、助理总经理、副总经理;1987年10月至1991年5月历任中国银行总行资金部副处长、处长;1982年8月至1987年9月任中国银行卢森堡分行外汇部经理;1978年2月至1982年7月, 先后在中国银行总行财会部、中国银行伦敦分行、卢森堡分行从事资金交易工作。秦先生出生于1955年5月,1978年毕业于北京外贸学院。

(三)证券投资基金托管情况

截止到2007年3月末,中国银行已托管景宏、同盛、兴安、同智优势成长、易方达平稳增长、易方达策略成长、易方达策略成长二号、易方达积极成长、易方达货币市场、易方达月月收益、易方达深证100交易型开放式指数、嘉实服务增值、嘉实成长收益、嘉实理财通系列(含嘉实稳健、嘉实增长、嘉实债券)、嘉实货币市场、嘉实沪深300指数、嘉实超短债、嘉实主题精选、银华优势企业、银华优质增长股票型、海富通收益增长、海富通货币市场、海富通股票、万家180指数、金鹰成份股优选、华夏回报、华夏回报二号、华夏大盘精选、景顺长城景系列(含景顺长城动力平衡、景顺长城货币市场、景顺长城优选股票)、景顺长城鼎益股票型、泰信天天收益、泰信优质生活、招商先锋、大成蓝筹稳健、大成财富管理2020、泰达荷银行业精选、国泰金象保本增值、国泰金鹿保本增值混合、国泰金鹏蓝筹价值、友邦华泰盛世中国、南方高增长、工银瑞信核心价值股票型、华宝兴业动力组合、华宝兴业先进成长股票型、国海富兰克林潜力组合基金等49只证券投资基金,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币市场型、指数型、行业型等多种类型的基金和理财品种,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

(四)基金托管部门的设置及员工情况

中国银行总行于1998年设立基金托管部,为进一步树立以投资者为中心的服务理念,根据不断丰富和发展的托管对象和托管服务种类, 中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部,下设覆盖销售、市场、运营、风险与合规管理、信息技术、行政管理等各层面的多个团队;并在上海市分行、深圳市分行设立托管业务团队。

中国银行托管及投资者服务部现有员工90余人,其中硕士学历以上人员21人,具有一年以上海外工作和学习经历的人员有10余人。

(五)基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

中国银行努力构建严密内部控制体系,以保证各项业务持续健康发展。中国银行内控建设的总目标是:以完善的内部控制组织体系为保障,以体现制衡原则、健全有效的制度为基础,以精细化的过程为着眼点,以激励约束机制和问责制为引导,以信息科技手段为依托,大力培育合规文化,努力构建全面系统、动态、主动和可证实的内部控制体系。

为实现上述目标,中国银行从明确职责入手,完善内部控制组织体系建设;从制度建设入手,夯实内部控制基础;从细节入手,实现精细化的过程控制;从完善激励约束机制和问责制入手,引导内部控制目标的实现;从加强信息技术手段入手,提高内部控制水平和质量;从加强教育培训入手,促进合规文化的形成。

2、内部控制组织结构

中国银行股份有限公司自2004年8月26日成立以来, 按照国家有关法律法规制定了新的公司章程,形成了由股东大会、董事会、监事会和高级管理层构建的现代股份公司治理架构。

(1) 董事会负责制订总体风险偏好、审阅及批准本行的风险管理目标及策略。董事会下设风险政策委员会,并成立了稽核委员会。

风险政策委员会主要职责包括评估和监督本行风险管理政策及内部控制政策的实施、监督已确立的风险领域敞口、监控和评估本行风险偏好、审核本行法律与合规事务程序的有效性和监督其实施,以及审查及批准超出授予本行行长信贷审批权限的信贷决定。总行风险管理部是风险政策委员会的秘书机构,风险管理部拟订风险管理策略及工作计划, 并牵头拟定及管理风险管理政策及管理风险管理政策及程序。

中国银行历来重视内部稽核职能,中国银行的内部稽核是内部独立客观的监督与评价活动,对本行风险管理和内部控制的适当性和有效性进行审查与评估, 负责跟进被稽核发现的问题及监督整改行动。2005年11月,董事会及稽核委员会采纳了内部稽核章程,进一步明确内部稽核职能独立于业务部门,并由董事会的稽核委员会领导,在董事会授权下,稽核委员会负责提名总稽核及评估其表现、审查及核准内部稽核政策、内部稽核组织架构、年度内部稽核计划及预算,以及审查内部稽核职能的有效性。中国银行已于境内一级分行及主要海外分行与子公司设立内部稽核部门,各家境内一级分行内部稽核工作负责人均由总行委任及考核,向总行的内部稽核部门及分行行长报告。中国银行建立了问责制,明确界定了内部稽核部门及稽核人员的责任,相关的内部稽核部门或人员的工作表现被纳入年度绩效考核。

(2) 中国银行股份有限公司高级管理层负有整体管理责任,管理本行风险的各个方面,包括风险管理策略、措施和信贷政策,并批准风险管理的内部规则、措施及程序。高级管理层下设内部控制委员会、资产负债管理委员会、资产处置委员会和反洗钱工作委员会。

内部控制委员会负责监督全行内部控制体系的总体运行,决定内部控制基本制度,评估内部控制体系的有效性,以及识别内部控制体系存在的不足和缺陷,督导改进措施的落实,审阅及批准本行主要内部控制政策及相关实施计划,制订本行有关操作风险识别、评估、监测、控制、计量等管理制度和报告制度,并不时聘用内部和外部专家评估内部控制的有效性和提供改进建议。法律与合规部是内部控制委员会的秘书机构,该部负责管理法律风险、合规风险,并牵头协调内部控制管理。

资产负债管理委员会监督本行整体资产和负债的管理,以及根据风险政策委员会所采用的一般风险管理政策,制订有关管理政策。资产负债管理部是资产负债管理委员会的秘书机构,该部按照资产负债管理委员会制订的政策,管理本行流动性,预测本行流动性的需求和风险,并对内重新分配资金以满足流动性管理的需要。

资产处置委员会审核有关处置不良资产的战略及政策,负责审批处置、清收及收回金额超出境内一级分行及海外分行的授权限额的不良贷款的建议。授信执行部是资产处置委员会的秘书机构。

反洗钱工作委员会负责反洗钱及打击恐怖主义融资事宜,法律与合规部是反洗钱工作委员会的秘书机构。

(3) 托管及投资者服务部总经理对托管业务的风险控制负第一责任。部门内部设有专门的风险控制小组,作为部内风险管理与内部控制的审议和决策机构,负责审议决定托管及投资者服务部风险管理战略、基本原则、风险管理目标和重大政策措施,检查和监督风险管理战略、方针和政策的执行情况。针对托管业务的特点,托管及投资者服务部内部设立高级合规官和风险与合规管理团队,具体开展部门内部内控及风险管理的相关工作。

3、内部控制制度及措施

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权,并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自1998年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求,以控制和防范基金托管业务风险为主线,制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度,将风险控制落实到每个工作环节;在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙,安装了录音监听系统,以保证基金信息的安全;建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度,保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全;制定了内部信息管理制度,严格遵循基金信息披露规定和要求,及时准确地披露相关信息。

4、其他事项

最近一年内,基金托管人基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行为,未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

(六)托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《证券投资基金会计核算办法》、基金合同的相关规定,托管人就基金的投资范围、投资组合比例、投资限制、基金管理人报酬和基金托管人托管费的计提比例和支付方法、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配等事项,对基金管理人进行业务监督、复核。基金托管人在履行上述职责过程中,如发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当立即通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。

四、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构:

(1)直销中心

本公司在上海开设直销中心。
地址:上海市世纪大道88号金茂大厦48层
邮政编码:200121
直销中心电话:021–50499588–301、302
直销中心传真:021–50499663、50499667

(2)网上交易

投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的申购、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

(2)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

(3)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:上海市延平路135号
法定代表人:祝幼一
电话:021–62580818
传真:021–62583439
联系人:芮敏祺
服务热线:400–8888–666;021–962588
公司网站:www.gtja.com

(4)光大证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔15–16楼
法定代表人:王明权
电话:021－50818887
传真:021－68815009
联系人: 刘晨
客户服务热线:021－68823685
公司网址:www.ebscn.com

(5)海通证券股份有限公司
注册地址:上海淮海中路98号
办公地址:上海淮海中路98号
法定代表人:王开国
电话:021－53594566
服务热线:021–962503
联系人:金芸
公司网址:www.htsec.com

(6)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:肖时庆
联系人:李洋
电话:010–66568047
客户服务电话:800－820－1868
网站:www.chinastock.com.cn

(7)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

(8)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40层
法定代表人:宫少林
电话:0755–82943167
联系人:黄健
客户服务热线:4008888111、0755–26951111
公司网址:www.newone.com.cn

(9)广发证券股份有限公司
注册地址:广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室
办公地址:广东广州天河北路大都会广场36、38、41和42楼
法定代表人:王志伟
联系人:肖中梅
电话:020–87555888
传真:020–87555305
客户服务电话:(020)87555888转各营业网点
公司网站:www.gf.com.cn

(10)长江证券有限责任公司
注册地址:武汉市新华路特8号
办公地址:武汉市新华路特8号
法定代表人:胡运钊
电话:021–63296362
传真:021–51062920
联系人:甘露
服务热线:4008–888–999
公司网址:www.cz318.com.cn

(11)东吴证券有限责任公司
注册地址:江苏省苏州市十梓街298号
办公地址:江苏省苏州市石路爱河桥26号
法定代表人:吴永敏
联系人:方晓丹
电话:0512–65581136
传真:0512–65588021
客户服务电话:0512–96288
公司网站:www.dwzq.com.cn

(12)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:马国强
联系人:盛宗凌
电话:0755–82493561
客服电话:400–8888–555
公司网站:www.lhzq.com

(13)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

(14)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:余江
电话:0755–82440136
客服电话:95511
公司网址:www.pa18.com

(15)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
法定代表人:王东明
电话:010–84864818
传真:010–84865560
联系人:陈忠
公司网址:www.ecitic.com

(16)东方证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东大道720号20楼
法定代表人:王益民
联系人:吴宇
电话:021–50367888
传真:021–50366868
客户服务热线:021–962506
公司网站:www.dfzq.com.cn

(17)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
法定代表人:兰荣
电话:021–68419974
联系人:杨盛芳
客户服务热线:021–68419974
公司网站:www.xyzq.com.cn

(18)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
联系人:王勤
电话:0571–85783715
公司网址:www.bigsun.com.cn

(19)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:林建闽
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

基金管理人可根据有关法律法规的要求选择其他机构代理销售基金,并及时公告。

(二)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:海华永泰律师事务所
住所:上海市浦东南路855号世界广场24楼
办公地址:上海市浦东南路855号世界广场24楼
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
住所: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
电话:(021) 61238888
传真:(021) 61238800
联系人:陈兆欣
经办注册会计师:肖峰、陈玲

五、基金简介

基金名称:华宝兴业先进成长股票型证券投资基金
基金类型:契约型开放式基金

六、基金的投资

(一)本基金投资目标、理念、范围、策略、业绩比较基准和风险收益特征

1、投资目标

分享我国经济增长方式转变过程中和转变完成后的先进企业的成长, 在控制风险的前提下为基金份额持有人谋求长期超额的回报。

2、投资理念

先进引领成长,创造超额回报。

3、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具,如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

4、投资策略

(1)资产配置策略

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。本基金股票投资比例为60%–95%,其中投资于先进企业股票占非现金资产的比例不低于80%,权证投资比例为0%–3%,债券及现金投资比例为5%–40%(其中,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于5%)。"先进企业"是指具备创新能力强、注重资源节约与环境友好、充分发挥人力资源优势这三个先进因素之一的企业。

(2) 股票投资策略

本基金认为,公司未来盈利的增长是股价上涨的主要驱动因素,在中国经济长期高速增长的背景下,创新能力强、注重资源节约和环境保护、充分发挥人力资源优势的先进企业具有更大的发展空间,投资于先进企业可以获取长期超额回报。因此将对上市公司基本面的深入研究和长期前景的关注作为基金的投资基础。

1. 本基金首先将在公司三级股票库的基础上选用7个定量指标来筛选出排名靠前、成长潜力较大的上市公司作为本基金的备选库。这7个定量指标分别为:

a. 成长指标:过去三年平均主营业务收入增长率、过去三年平均息税折旧前利润(EBITA)增长率、未来一年预测每股收益(EPS)增长率、未来第二年预测每股收益(EPS)增长率;

b. 价值指标:预测动态市盈率;

c. 盈利指标:过去三年平均净资产收益率(ROE)、过去三年平均投资回报率(ROIC)。

2. 然后,本基金将对有成长潜力的上市公司进行进一步案头研究和实地调研,深入研究企业的基本面,精选符合本基金先进性判断的上市公司。

a. 企业先进性判断

创新能力:重点关注具有先进的设备和技术、较好的品牌、创新的盈利模式和管理制度的企业。具体的指标包括研发(R&D)经费支出、研发(R&D)经费投入强度、专利申请数、发明专利量比重、新产品产值率、信息化程度等;

资源节约和环境保护能力:重点关注资源节约和环境友好的企业、开发生产新能源新材料的企业、开发生产资源节约和环境保护相关产品的企业。具体的指标包括废水排放量、废气排放量、固体废弃物排放量、资源消耗率、单位产值废水排放率、单位产值废气排放率等;

人力资源利用能力:重点关注技术密集型企业,兼顾劳动密集型企业。具体的指标包括研发、技术人员数量和占比、员工培训支出、知识水平程度、业务熟练水平等。

b. 企业基本因素判断:规模、产能、管理、竞争优势等。

3. 行业配置策略

重点关注国家产业结构调整中鼓励类行业,同时也兼顾有先进企业的传统行业。

最后优选成长性高、有持续成长能力且估值合理的先进企业作为本基金最终的投资组合,并进行定期调整。

(3) 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。

5、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准是新上证综指收益率。

新上证综指是我国证券市场由权威机构发布的反映股权分置改革实施后公司概况的指数,当前由沪市所有G股组成,此后实施股权分置改革的股票将在方案实施后的第二个交易日纳入指数。指数以总股本加权计算。随着股权分置改革的全面推进,将不断有新的样本股加入新上证综指;在不远的将来,随着市场大部分上市公司完成股改,新上证综指将逐渐成为主导市场的核心指数。

当市场出现更合适、更权威的比较基准时,本基金管理人有权选用新的比较基准,并将及时公告。

6、风险－收益特征

本基金属于证券投资基金中的较高风险的品种

(二)投资程序

1、投资决策委员会负责投资决策

投资决策委员会定期和不定期召开会议,负责就基金重大战略和资产配置做出决策。

2、金融工程部负责跟踪数量分析模型

金融工程部实时跟踪数量分析模型,定期将股票排名结果提交给研究部和基金经理。

3、研究部负责投资研究和分析

宏观研究人员通过研究其他证券公司和基金管理公司的报告, 通过走访政府决策部门和研究部门,研究经济形势、经济政策(货币政策、财政政策、区域政策、产业政策等)、重大技术发明等,撰写宏观研究报告,就基金的股票、债券、现金比例提出建议。

行业研究人员根据金融工程部定期提交的股票排名,以排名靠前的股票为主要研究对象,考察上市公司的基本面和长期发展前景,预测上市公司未来2－3年的经营情况,选择重点上市公司进行调研,撰写行业和子行业研究报告及上市公司调研报告,对个股买卖提出具体建议。

4、基金经理小组负责投资执行

基金经理小组根据宏观经济和行业发展,结合量化分析等工具对股市做出判断,提出投资组合的资产配置比例建议,同时结合数量分析模型的股票排序和研究员的报告,形成投资计划提交投资决策委员会,并根据投资决策委员会的决策,具体实施投资计划。

经投资决策委员会和总经理审核投资组合方案后,基金经理向交易部下达具体的投资指令,交易员根据投资决定书执行指令。

5、绩效评估

主要包括四项核心功能:风格检验、风险评估、投资绩效的风险调整和业绩贡献,由绩效评估人员利用相关工具评估。

6、内部控制

内部控制委员会、督察长、副总经理、内控审计风险管理部负责内控制度的制定,并检查执行情况。

(三)投资限制与禁止行为

1、组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点,通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制:

(1)本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;
(2)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;
(3)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券总和,其市值不超过该证券的10%;
(4)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;
(5)本基金股票、权证、债券、现金的投资比例范围为:股票占基金资产净值的60%－95%,权证占0%－3%,债券及现金占5%－40%(其中现金或者到期日在一年内的政府债券占5%以上);
(6)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过基金总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
(7)本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0.5%;
(8)法律法规或中国证监会对上述比例限制另有规定的,应从其规定。

因证券市场波动、上市公司合并、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比例不符合上述(1)—(5)项规定的投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

2、禁止行为

本基金禁止从事下列行为:
(1)承销证券;
(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,但是法律法规另有规定的除外;
(5)向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、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、行政法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。

(四)基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

(五)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,不参与上市公司的经营管理;
2、有利于基金财产的安全与增值;
3、独立行使股东权利,保护基金投资人的利益;
4、基金管理人按照有关规定代表基金出席上市公司股东大会,行使股东权利,履行股东义务。

(六)基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至2007年3月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

1、基金资产组合情况

项目	金额(元)	占总资产比例
股票	4,243,757,249.25	90.57%
债券	0.00	0.00%
权证	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金合计	301,516,655.97	6.43%
资产支持证券	0.00	0.00%
其他资产	140,337,951.55	3.00%
合计	4,685,611,856.77	100.00%

2、按行业分类的股票投资组合

序号	行业分类	市值(元)	占净值比例
1	A农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
2	B采掘业	145,221,387.76	3.18%
3	C制造业	2,529,149,101.21	55.47%
	其中:C0食品、饮料	219,010,861.35	4.80%
	C1纺织、服装、皮毛	79,857,521.80	1.75%
	C2木材、家具	0.00	0.00%
	C3造纸、印刷	0.00	0.00%
	C4石油、化学、塑胶、塑料	171,112,000.00	3.75%
	C5电子	165,877,485.12	3.64%
	C6金属、非金属	703,784,661.77	15.44%
	C7机械、设备、仪表	863,588,864.19	18.94%
	C8医药、生物制品	241,043,866.58	5.29%
	C99其他制造业	84,873,840.40	1.86%
4	D电力、煤气及水的生产和供应业	59,805,000.00	1.31%
5	E建筑业	0.00	0.00%
6	F交通运输、仓储业	144,244,854.07	3.16%
7	G信息技术业	274,289,211.88	6.02%
8	H批发和零售贸易	249,864,338.00	5.48%
9	I金融、保险业	494,975,680.35	10.86%
10	J房地产业	171,271,342.98	3.76%
11	K社会服务业	159,171,333.00	3.49%
12	L传播与文化产业	0.00	0.00%
13	M综合类	15,765,000.00	0.35%
	合计	4,243,757,249.25	93.07%

3、按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	600879	火箭股份	11,600,000	228,172,000.00	5.0042%
2	601166	兴业银行	8,000,000	217,600,000.00	4.7724%
3	601318	中国平安	4,500,227	211,735,680.35	4.6438%
4	000069	华侨城A	8,000,000	158,720,000.00	3.4810%
5	000970	中科三环	9,600,000	136,320,000.00	2.9897%
6	000063	中兴通讯	3,000,000	131,700,000.00	2.8884%
7	600296	S 兰 铝	8,999,937	131,489,079.57	2.8838%
8	600100	同方股份	5,409,858	129,079,211.88	2.8309%
9	600582	S 天 地	3,000,000	120,780,000.00	2.6489%
10	600276	恒瑞医药	3,300,000	115,434,000.00	2.5317%

4、按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占净值比例
1	国 债	0.00	0.00%
2	金融债	0.00	0.00%
3	央行票据	0.00	0.00%
4	企业债	0.00	0.00%
5	可转债	0.00	0.00%
6	其 他	0.00	0.00%
	合 计	0.00	0.00%

5、按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

本报告期末本基金债券投资市值为0.00元。

6、基金资产支持证券投资前十名明细

本报告期内本基金未发生资产支持证券投资,特此报告。

7、投资组合报告附注

(1)报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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先进企业股票,基金管理人建立有基金股票备选库。本报告期内本基金处于六个月的建仓期。

(3)基金的其他资产构成

单位:元

项目	金额
交易保证金	2,857,047.34
证券清算款	129,966,123.35
应收利息	102,348.26
应收申购款	7,219,990.20
待摊费用	192,442.40
合计	140,337,951.55

(4)本基金在本报告期内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:
1)股权分置改革被动持有:无。
2)主动投资:无。

(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。

七、基金的业绩

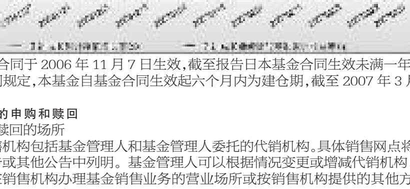
本基金业绩数据为截止2007年3月31日("报告期末")的数据,本报告中所列数据未经审计。

(一)本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	26.17%	2.06%	17.88%	2.45%	8.29%	–0.39%

(二)自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动的比较

先进成长基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2006年11月7日至2007年3月31日)



注:1、本基金合同于2006年11月7日生效,截至报告日本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定,本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期,截至2007年3月31日本基金尚处于建仓期。

八、基金份额的申购和赎回

(一)申购与赎回的场所

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)申购与赎回办理的开放日及时间

1、开放日及开放时间

上海证券交易所和深圳证券交易所同时开放交易的工作日为本基金的开放日。具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易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开放时间进行相应的调整并公告。

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。

(下转D13版)