华宝兴业多策略增长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,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 11 月 30 日, 有关财务数据和净值表现截止日为 2007 年 9 月 30 日,数据未经审计。

一、《基金合同》生效日期

本基金自 2004 年 3 月 31 日到 2004 年 4 月 30 日向个人投资者和机构投资者同时发售,《基金合同》于 2004 年 5 月 11 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、南方证券有限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。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。

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。

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。

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。

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,女,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

牟旭东先生,经济学硕士,曾在南方证券有限公司担任行业研究部副经理,历任华宝兴业基金管理有限公司高级分析师、研究部副总经理、研究部总经理。2003 年 1 月加入本公司。2007 年 10 月开始担任多策略增长基金基金经理。

多策略增长基金的历任基金经理为余荣权先生,任职时间为 2006 年 4 月至 2007 年 4 月。黄小坚先生,任职时间为 2006 年 9 月至 2007 年 10 月。

3、投资决策委员会成员

任志强先生,投资总监。

Gabriel Gondard 先生,投资副总监。

魏东先生,投资副总监、投资部总经理、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。

雷勇先生,海外投资管理部总经理。

牟旭东先生,多策略增长基金基金经理。

(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:壹仟玖佰肆拾贰亿叁仟零贰拾伍万元人民币

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在中国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(股票代号:HK0939)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。于 2006 年末,中国建设银行市值达 1,429.94 亿美元,跻身于全球十大上市银行之列。截至 2006 年 12 月 31 日止,中国建设银行总资产为人民币 54,485.11 亿元,客户存款为人民币 47,212.56 亿元。2006 年,中国建设银行实现净利润人民币 463.19 亿元,较上年增长 18.02%,每股盈利为人民币 0.21 元,平均资产回报率为 0.92%,平均股东权益回报率为 15%。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、东京及首尔设有分行,在伦敦、纽约设有代表处。2006 年 8 月 24 日,中国建设银行在香港与美国银行签署协定,收购美国银行在香港的全资子公司美国银行(亚洲)股份有限公司 100%的股权,并于 2006 年 12 月 29 日完成收购交割,美国银行(亚洲)有限公司更名为“中国建设银行(亚洲)股份有限公司”。中国建设银行在《银行家》2006 年公布的全球银行按一级资本排名中,名列中国银行业榜首,在世界大银行中列第 11 位。中国建设银行在《福布斯》2006 年全球领先企业榜中为第 65 名,列中国第二位。在《亚洲周刊》2006 年 7 月公布的亚洲银行 300 强排名中,中国建设银行在“利息收入净值最高的银行”和“纯利最高的银行”两项排名中均列第一位,被誉为“亚洲最赚钱的银行”。此外,在 2006 年度《亚洲金融》亚洲最佳公司评选中,中国建设银行入选“最佳管理公司”、“最佳公司管治”、“最佳派息承诺”排行榜。

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、监督稽核处和投资委托托管团队等 8 个职能处室,现有员工 80 余人。

(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领导经验。

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、国际业务部工作,对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有较丰富相关工作经验。

(三)基金托管业务经营情况

截止到 2007 年 6 月 30 日,中国建设银行已托管兴华、兴和、泰和、金鑫、金盛、通乾、鸿飞、银丰等 8 只封闭式证券投资基金,以及华夏成长、融通新蓝筹、博时价值增长、华宝兴业宝康系列(包括宝康消费品、宝康债券、宝康灵活配置 3 只子基金)、博时裕富、长城久恒、银华保本增值、华夏现金增利、华宝兴业多策略增长、国泰金马稳健回报、银华－道琼斯 88 精选、上投摩根中国优势、东方龙、博时主题行业、华富竞争力优选、华宝兴业现金宝、上投摩根货币市场、华夏红利、博时稳定价值、银华核心价值、上投摩根阿尔法、中信红利精选、工银瑞信货币市场、长城消费增值、华安上证 180ETF、上投摩根双息平衡、泰达荷银效率优选、华夏深圳中小企业板 ETF、交银施罗德稳健配置、华宝兴业收益增长、华富货币市场、工银瑞信精选平衡、鹏华价值优势、中信稳定债券、华安宏利、上投摩根成长先锋、博时价值增长贰号、海富通风格优势、银华富裕主题、华夏优势增长、信诚精萃成长、工银瑞信稳健成长、信达澳银领先增长、诺德价值优势、工银瑞信债券、国泰金鼎价值、富国天博、融通领先成长、华宝兴业行业精选等 51 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)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

营业期限:持续经营

客服电话:95555

联系人:朱虹

电话:0755－83195834

公司网站:www.cmbchina.com

(3) 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:吴杰

客户服务电话:95568

公司网址:www.cmbc.com.cn

(4)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

客服电话:400–8888–555

电话:0755–82490000

联系人:范雪玲

公司网站:www.lhzq.com

(5)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

(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:北京市东城区朝内大街 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)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:广发证券网 http://www.gf.com.cn

(9)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

(10)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:400–8888–001、021–962503 或拨打各城市营业网点咨询电话

联系人:金芸

公司网址:www.htsec.com

(11)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

(12)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:021–54038844

服务热线:021–962505

联系人:王序微

公司网址:www.sw2000.com.cn 或 www.sywg.com.cn

(13)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:021–68419974

公司网站:www.xyzq.com.cn

(14)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:北京市朝阳区新源南路 6 号京城大厦 3 层

法定代表人:王东明

电话:010–84588888

传真:010–84865560

联系人:陈忠

公司网址:www.ecitic.com

(15)国元证券有限责任公司

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

联系人:李蔡

客户服务热线:4008888777(全国统一客户服务热线)

公司网址:www.gyzq.com.cn

(16)东吴证券有限责任公司

注册地址:江苏省苏州市石路爱河桥 26 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

公司网址:www.dwzq.com.cn

(17)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

(18) 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:余江 庄维佳

电话:0755–82450826 22622287

传真:0755–82433794

客户服务热线:95511

网站:www.pa18.com

(19) 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

(20)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

(21)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

(22) 中信万通证券有限责任公司

注册地址:青岛市崂山区香港东路 316 号

办公地址:青岛市东海西路 28 号

法定代表人:史洁民

电话:0532–85022026

传真:0532–85022026

联系人:丁韶燕

客户咨询电话:0532–96577

公司网址:www.zxwt.com.cn

(23) 华泰证券有限责任公司

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

联系人:李金龙、张小波

客户服务热线:025－84579897

公司网址:WWW.HTSC.COM.CN

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: 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) 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:华宝兴业多策略增长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)投资目标

通过各风格板块间资产配置以及各板块内精选个股, 在控制风险的前提下为持有人谋求最大回报。

(二)投资范围和对象

本基金的投资范围为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的允许基金投资的其他金融工具。

本基金的股票投资对象按流通市值和市净率分为四大股票风格板块: 大盘价值、大盘成长、中小盘价值、中小盘成长。80%以上的股票资产投资于符合各风格板块精选个股标准的股票。

(三)投资理念

风格转换及个股精选策略能够有效控制风险,创造超额收益。

(四)投资策略

本基金看好中国经济的发展前景和证券市场存在的投资机会, 注重资产在各风格板块间的配置,同时在各风格板块内部精选个股。

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%－95%;债券为 0%－45%,现金或者到期日在一年内的政府债券比例在 5%以上。

1、股票投资策略

(1)风格板块轮动策略

根据数量化辅助模型和公司内部研究支持以及基金经理自身判断, 决定股票资产在各风格板块间的配置。当某一风格板块相对大市的超额收益率出现上升或者下降趋势并到达预设的临界点时,我们增加或者减少该板块的权重。

(2) 风格板块的股票精选策略

针对各风格板块,有不同的板块内精选个股标准,定性指标与定量指标相结合,定性指标主要考察上市公司的治理结构、管理水平、竞争优势及行业特点等因素。

1)大盘价值板块:采用股息率、市盈率、市净率、市销率、市现率五个指标。股息率较高的股票得分较高,市盈率、市净率、市销率、市现率较低的股票得分也较高。

2)大盘成长板块:我们侧重于选取具有难以超越的竞争优势的个股。主要考虑公司是否具有优越的管理团队,具有长期发展策略;具有垄断优势;公司所处行业基本面已经好转,且已有融资计划的上市公司;所在行业中处于领先地位,或者占据绝对多数的市场份额;高收益增长率,高利润率;专利产品多,低成本的生产和/或分销能力。

3)中小盘价值:我们侧重选取内在价值被市场低估的个股。具体的评价指标是股票被低于其清算价值或其有形帐面价值出售;相对于其获益潜力或者重置成本来说,股票价格偏低;公司进行资产重组,股票价格大大低于市场估值;公司具有至少 10–20%的增长率,财务状况良好,市盈率低于市场平均水平。

4)中小盘成长:我们倾向于选择业绩可能大幅增长、股本扩张能力强的上市公司的个股。主要考虑过往盈利持续增长或盈利增长潜力巨大;获取具有吸引力的净资产收益率(ROE)的能力;低于基金经理对未来三年预期盈利增长率的 P/E 指标;不断扩大的市场份额;良好的资产负债情况;股东及管理团队实力雄厚;较强的新产品开发能力。

2、债券投资策略

(1)本基金定位为股票型基金;在政策允许的情况下,本基金债券投资的下限为零;

(2)本基金债券投资的主要目的是为了回避特定时期股票投资可能存在的风险,同时能够获取债券投资的收益;

(3)本基金投资债券将采取稳健的投资策略。

3、权证投资策略

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。

(五)业绩比较基准

80%×复合指数+20%×上证国债指数。其中,

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

成分指数总流通市值＝上证 180 流通市值＋深证 100 流通市值

(六) 投资程序

1、公司研究部通过内部独立研究,并借鉴其他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, 按照基金的合同规定, 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他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、内部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,内控审计风险管理部对基金投资过程进行日常监督,出具风险报告。

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。

(七)基金的禁止行为

1、投资于其他基金;

2、以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券;

3、动用银行信贷资金从事证券买卖;

4、将基金财产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款;

5、从事证券信用交易;

6、以基金财产进行房地产投资;

7、从事有可能使基金承担无限责任的投资;

8、将基金财产投资于与基金托管人或基金管理人有利害关系的公司发行的证券;

9、违反证券交易业务规则,利用对敲、倒仓等行为来操纵和扰乱市场价格;

10、进行高位接盘、利益输送等损害基金份额持有人利益的行为;

11、通过股票投资取得对上市公司的控制权;

12、因基金投资股票而参加上市公司股东大会的、与上市公司董事会或其他持有 5%以上投票权的股东恶意串通,致使股东大会表决结果侵犯社会公众股东的合法利益;

13、法律、法规及监管机关规定禁止从事的其他行为。

(八)基金投资组合比例限制

1、基金持有的股票、债券比例不低于基金资产总值的 80%;

2、基金持有一家公司的股票,不得超过基金资产净值的 10%;

3、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%;

4、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。

由于基金规模或市场的变化导致的投资组合超过上述约定的比例不在限制之内, 但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整,以达到标准。

5、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。

(九)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、独立行使股东权利,保护基金投资人的利益;

4、基金管理人按照国家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。

(十)基金的融资

基金可以按照国家的有关规定进行融资。

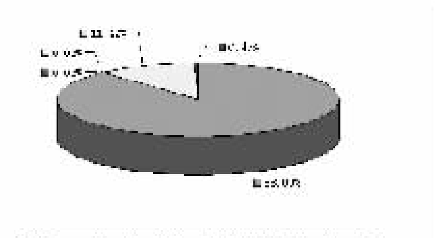
七、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至 2007 年 9 月 30 日,本报告中所列财务数据未经审计。

1、基金资产组合

截至 2007 年 9 月 30 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	3,104,571,602.11	88.03%
债券投资	1,013,424.72	0.03%
权证投资	1,011,540.99	0.03%
银行存款及清算备付金	402,740,253.35	11.42%
其它资产	17,509,068.29	0.49%
合计	3,526,845,889.46	100.00%



2、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	3,017,000.00	0.09%
2	采掘业	394,102,020.00	11.24%
3	制造业	1,048,636,656.40	29.90%
	其中:食品、饮料	137,710,000.00	3.93%
	纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
	木材、家具	0.00	0.00%
	造纸、印刷	0.00	0.00%
	石油、化学、塑胶、塑料	153,709,528.05	4.38%
	电子	7,744,009.55	0.22%
	金属、非金属	541,083,533.08	15.43%
	机械、设备、仪表	146,545,428.20	4.18%
	医药、生物制品	38,691,300.00	1.10%
	其他制造业	23,152,857.52	0.66%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00%
5	建筑业	0.00	0.00%
6	交通运输、仓储业	90,840,361.68	2.59%
7	信息技术业	100,572,200.00	2.87%
8	批发和零售贸易	253,150,147.66	7.22%
9	金融、保险业	749,900,243.92	21.39%
10	房地产业	309,364,817.58	8.82%
11	社会服务业	103,574,154.87	2.95%
12	传播与文化产业	0.00	0.00%
13	综合类	51,414,000.00	1.47%
	合计	3,104,571,602.11	88.54%

3、基金投资前 10 名股票明细

序号	代码	名称	股票数量(股)	期末市值(元)	市值占基金净值比例
1	000002	万 科 A	4,000,000	120,800,000.00	3.4450%
2	000937	金牛能源	3,830,000	120,453,500.00	3.4351%
3	000060	中金岭南	1,829,965	117,117,760.00	3.3400%
4	601166	兴业银行	2,036,224	114,883,758.08	3.2763%
5	002024	苏宁电器	1,580,000	108,419,600.00	3.0919%
6	600016	民生银行	6,800,000	107,508,000.00	3.0659%
7	600036	招商银行	2,800,000	107,156,000.00	3.0559%
8	000069	华侨城 A	1,689,903	103,574,154.87	2.9537%
9	600030	中信证券	1,030,000	99,611,300.00	2.8407%
10	600331	宏达股份	1,204,842	96,628,328.40	2.7557%

4、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	0.00%
2	金融债券	0.00	0.00%
3	企业债券	1,013,424.72	0.0289%
4	可转换债券	0.00	0.00%
	合计	1,013,424.72	0.0289%

5、基金债券投资前 5 名明细

序号	债券名称	市值(元)	占净值比例
1	国安债 1	1,013,424.72	0.0289%

6、基金资产支持证券投资前 10 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)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)本基金股票投资对象为上海和深圳两个交易所上市交易,并符合基金投资策略规定的各风格板块选股标准的股票,没有特定的备选股票库。

(3)本基金投资组合中其他资产包括:交易保证金 1,762,587.23 元、证券清算款 1,609,793.03 元、应收利息 104,810.26 元、应收申购款 14,001,631.98 元 、待摊费用 30,245.79 元。

(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获得的权证明细如下:

a.股权分置改革被动持有:无

b.主动投资:

权证代码	权证名称	数量(份)	成本(元)
031005	国安 GAC1	80,633	439,869.14
总计		80,633	439,869.14

(6)基金管理人于 2007 年 8 月 8 日通过代销机构申购本基金 300,000 元,申购费率为 1.5%。基金管理人按照有关规定于 2007 年 8 月 6 日对该事项进行了公开披露。

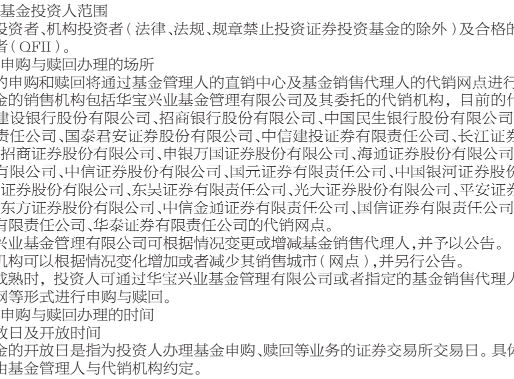
八、基金的业绩

基金业绩截止日为 2007 年 9 月 30 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。

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
2004/05/11–2004/12/31	–3.26%	0.78%	–12.24%	1.08%	8.98%	–0.29%
2005/01/01–2005/12/31	–1.84%	1.06%	–3.62%	1.08%	1.78%	–0.02%
2006/01/01–2006/12/31	106.10%	1.21%	92.16%	1.13%	13.94%	0.08%
2004/05/11–2007/09/30	393.04%	1.37%	263.30%	1.33%	129.74%	0.04%
2007/01/01–2007/09/30	151.93%	2.07%	123.58%	1.90%	28.35%	0.18%

2、基金累计净值增长率与比较基准收益率走势对比



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 2004 年 11 月 11 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。

九、基金的申购和赎回

(一)基金投资人范围

个人投资者、机构投资者(法律、法规、规章禁止投资证券投资基金的除外)及合格的境外机构投资者(QFII)。

(二)申购与赎回办理的场所

基金的申购和赎回将通过基金管理人的直销中心及基金销售代理人的代销网点进行。

本基金的销售机构包括华宝兴业基金管理有限公司及其委托的代销机构, 目前的代销机构为中国建设银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、联合证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、长江证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、国元证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、东吴证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、中信金通证券有限责任公司、国信证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、华泰证券有限责任公司的代销网点。

华宝兴业基金管理有限公司可根据情况变更或增减基金销售代理人,并予以公告。

销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市(网点),并另行公告。

条件成熟时, 投资人可通过华宝兴业基金管理有限公司或者指定的基金销售代理人以电话或互联网等形式进行申购与赎回。

(三)申购与赎回办理的时间

1、开放日及开放时间

本基金的开放日是指为投资人办理基金申购、赎回等业务的证券交易所交易日。具体业务办理时间由基金管理人与代销机构约定。

申购赎回的时间根据招募说明书及其更新的招募说明书的规定执行。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具体业务办理时间进行相应的调整并公告。

投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请的,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。

2、申购的开始时间及业务办理时间

本基金自 2004 年 6 月 18 日起开始办理日常申购业务。

3、赎回的开始时间及业务办理时间

本基金自 2004 年 8 月 10 日起开始办理日常赎回业务。

(四)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资产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、基金份额持有人赎回时,基金管理人按先进先出的原则对该持有人基金账户在该销售机构托管的基金份额进行处理,即先确认的份额先赎回,后确认的份额后赎回;

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

5、基金的申购与赎回申请以书面方式或经基金管理人认可的其他方式进行;

6、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,但应最迟在新的原则实施前三个工作日在至少一种指定媒体予以公告。

(五)申购与赎回的程序

(下转 D21 版)