

华宝兴业增强收益债券型证券投资基金 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2011年8月17日；有关财务数据和净值表现截止日为2011年6月30日，财务数据未经审计。

一、 《基金合同》生效日期

本基金自 2009 年 1 月 5 日到 2009 年 2 月 13 日向个人投资者和机构投资者同时发售,《基金合同》于 2009 年 2 月 17 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: 021-38505888

联系人: 韩东霞

股权结构: 中方股东华宝信托有限责任公司持有 51%的股份, 外方股东领先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、华宝信托有限责任公司董事长、华宝投资有限公司董事、总经理, 中国太平洋保险(集团)股份有限公司董事。

Alain Jean Patrick DUBOIS 先生, 董事, 硕士。曾任法国财政部预算办公室部门负责人、里昂信贷资本市场部从事研究开发工作、拉扎德兄弟银行部门经理、Arjil et Cie 银行董事总经理、德国商业银行资深产品设计师、法国兴业银行资深产品设计师、领先资产管理有限公司业务发展部负责人。现任领先资产管理有限公司董事长。

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。

谢文杰先生，董事，金融学硕士。曾任汇丰银行外汇及期权交易员、法国兴业银行及投资银行初级市场及衍生品团队负责人、法国兴业银行及投资银行债务融资部亚洲区（除日本外）董事总经理兼结构化衍生品主任、法国兴业亚洲有限公司环球市场部中国区销售及交易部门主管、法国兴业亚洲有限公司领先资产管理中国区业务部门主管。现任华宝兴业基金管理有限公司副总经理。

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

张永光（Jackson CHEUNG）先生，监事，工商管理硕士。曾在法国兴业银行主管银团贷款、项目融资、固定收益、外汇交易、衍生产品及结构性融资等工作，法国兴业银行亚洲区债务融资及衍生产品业务部总管。现任法国兴业银行集团中国区总裁。

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。现任华宝信托有限责任公司副总经理。

贺桂先先生，监事，本科。曾任华宝信托投资有限责任公司研究部副总经理。现任华宝兴业基金管理有限公司营运副总监。

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。

谢文杰先生，副总经理，金融学硕士。曾任汇丰银行外汇及期权交易员、法国兴业银行及投资银行初级市场及衍生品团队负责人、法国兴业银行及投资银行债务融资部亚洲区（除日本外）董事总经理兼结构化衍生品主任、法国兴业亚洲有限公司环球市场部中国区销售及交易部门主管、

法国兴业亚洲有限公司领先资产管理中国区业务部门主管。现任华宝兴业基金管理有限公司副总经理。

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。

黄小慧（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、本基金基金经理

华志贵先生，硕士研究生。1999年7月至2000年8月在上海广电股份有限公司从事技术、市场工作，2004年5月至2008年7月在上海东方证券股份有限公司从事证券投资工作，2008年8月至2009年9月在中欧基金管理有限公司从事证券投资工作。2009年9月加入华宝兴业基金管理有限公司，任基金经理助理兼高级分析师，2010年6月至今任华宝兴业现金宝货币市场基金、华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理，2011年4月至今兼任华宝兴业可转债债券型证券投资基金基金经理。

本基金的历任基金经理如下：

牟旭东先生，其任职期间为2009年2月至2011年2月；

曾丽琼女士，其任职期间为2009年2月至2010年6月。

5、固定收益投资决策委员会成员

任志强先生，副总经理、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。

Tan Weisi 先生，固定收益部总经理、华宝兴业宝康债券投资基金基金经理。

王智慧先生，研究部总经理。

华志贵先生，华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理、华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理、华宝兴业可转债债券型证券投资基金基金经理。

三、 基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币349,018,545,827元

联系电话：010-66105799

联系人：赵会军

（二）主要人员情况

截至2011年6月末，中国工商银行资产托管部共有员工145人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2011年6月，中国工商银行共托管证券投资基金219只，其中封闭式7只，开放式212只。自2003年以来，本行连续八年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的26项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（四）基金托管人的职责

基金托管人应当履行下列职责：

1. 安全保管基金财产；
2. 按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
3. 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
4. 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

5. 按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
6. 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
7. 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见；
8. 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
9. 按照规定召集基金份额持有人大会；
10. 按照规定监督基金管理人的投资运作；
11. 法律法规和《基金合同》规定的其它职责。

（五）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继 2005、2007、2009 年三次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的 SAS70（审计标准第 70 号）审阅后，2010 年中国工商银行资产托管部第四次通过 SAS70 审阅获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，SAS70 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

一）内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

二）内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

三）内部风险控制原则

- 1、合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务

经营管理活动的始终。

2、完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

3、及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

4、审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

5、有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

6、独立性原则。资产托管部托管的基金资产、托管人的自有资产、托管人托管的其他资产应当分离；直接操作人员和控制人员应相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

四) 内部风险控制措施实施

1、严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

2、高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

3、人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

4、经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

5、内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

6、数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

7、应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

五) 资产托管部内部风险控制情况

1、资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

2、完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

3、建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

4、内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

六) 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

根据《基金法》、《基金合同》、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自《基金合同》生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《基金合同》、托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告

中国证监会。基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

四、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1、直销机构：

(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) 中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

(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

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

(3) 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

(4) 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

(5) 交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

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

(6) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

联系人：邓炯鹏

联系电话：0755-83198888

公司网址：www.cmbchina.com

客户服务电话：95555

(7) 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：010-57092615

传真：010-57092611

联系人：董云巍

客户服务电话：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

(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

24 小时客户服务热线：95558

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：肖遂宁

联系人：张青

联系电话：0755-82088888

传真电话：0755-82080714

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：021-61618888

传真：021-63604199

客户服务热线：95528

公司网址：www.spdb.com.cn

(11) 广发银行股份有限公司

注册地址：广东省广州市农林下路 83 号

办公地址：广东省广州市农林下路 83 号

法定代表人：李若虹

客户服务电话：800-830-8003；400-830-8003

网址：www.gdb.com.cn

(12) 兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号中山大厦

法定代表人：高建平

网址：<http://www.cib.com.cn>

客户服务电话：95561 或拨打各城市营业网点咨询电话

(13) 江苏银行股份有限公司

住所：南京市洪武北路 55 号

法定代表人：黄志伟

网址：www.jsbchina.cn

客户服务电话：96098，40086-96098

(14) 渤海银行股份有限公司

办公地址：天津市河西区马场道 201-205 号

法定代表人：刘宝凤

网址：www.cbhb.com.cn

客户服务电话：400 888 8811

(15) 华夏银行股份有限公司

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

客户服务电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

(16) 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

法定代表人：万建华

电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：芮敏祺

服务热线：400-8888-666

公司网站: www.gtja.com

(17) 光大证券股份有限公司

注册地址: 上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人: 徐浩明

电话: 021-22169999

传真: 021-22161789

联系人: 刘晨

客户服务热线: 10108998、4008888788

公司网址: www.ebscn.com

(18) 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

(19) 中国银河证券股份有限公司

住所: 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: 顾伟国

客户服务电话: 4008-888-888

网站: www.chinastock.com.cn

(20) 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

(21) 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 39—45 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943666

联系人：林生迎

客户服务热线：4008888111、95565

公司网址：www.newone.com.cn

(22) 广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州天河北路大都会广场 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：黄岚

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：www.gf.com.cn

(23) 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

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

客户服务热线：95579 或 4008-888-999

公司客服网址：www.95579.com

(24) 东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦

法定代表人：吴永敏

联系人：方晓丹

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

客服电话：0512-33396288

网址：<http://www.dwzq.com.cn>

(25) 华泰联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A

法定代表人：马昭明

联系人：盛宗凌

电话：0755-82492000

客服电话：95513 公司网站：www.lhzq.com

(26) 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 或 www.sywg.com.cn

(27) 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：郑舒丽

电话：0755-22626172

客服电话：4008816168

公司网址：www.pa18.com

(28) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

法定代表人：王东明

电话：010-60838888

传真：010-60833739

联系人：陈忠

公司网址：www.ce.ecitic.com

(29) 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：潘鑫军

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

(30) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

法定代表人：兰荣

电话：021-38565785

联系人：谢高得

客户服务热线：4008888123

公司网站：www.xyzq.com.cn

(31) 中信金通证券有限责任公司

住所：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

法定代表人：沈强

客户服务电话：96598

公司网址：www.bigsun.com.cn

(32) 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：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：张智河

客户咨询电话：0532-96577

公司网址：www.zxwt.com.cn

(33) 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—882

传真：025—84579763

联系人：李金龙、张小波

公司网址：www.htsc.com.cn

客户服务热线：95597

（34）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：许刚

咨询电话：4006208888 或各地营业网点咨询电话

传真：021-50372474

（35）恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号邮编 010010

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号邮编 010010

法定代表人：庞介民

联系人：王旭华

联系电话：0471-4972343

网址：www.cnht.com.cn

（36）长城证券有限责任公司

注册地址：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

联系人：高峰

电话：0755-83516094

传真：0755-83516199

客户服务热线：0755-33680000、400 6666 888

长城证券网站：www.cc168.com.cn

（37）渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：杜庆平

电话：(022)28451861

传真：(022)28451892

联系人:王兆权

客服电话：400-651-5988

网址：www.bhzq.com

(38) 中国建银投资证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层至 21 层

法定代表人：杨明辉

传真：0755-82026539

客服电话：400-600-8008

网址：www.cjis.cn

(39) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼

法定代表人：牛冠兴

联系电话：0755-82558323

传真：0755-82558355

联系人：余江

客服电话：4008-001-001

公司网址：www.essences.com.cn

(40) 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

联系电话：010-65051166 或直接联系各营业部

公司网站：http://www.cicc.com.cn

(41) 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

(42) 齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客服电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

(43) 华福证券有限责任公司

地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

法定代表人：黄金琳

客服电话：96326（福建省外请加拨 0591）

公司网址：www.hfzq.com.cn

(44) 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

(45) 江海证券有限公司

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

客服电话：400-666-2288

公司网址：www.jhzq.com.cn

(46) 国都证券有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：常喆

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

(47) 东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

法定代表人：徐勇力

基金销售联系人：汤漫川

电话：010-66555316

传真：010-66555246

公司网站：www.dxzq.net.cn

公司客户服务电话：400-8888-993

(48) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

电话：0431-85096709

传真：0431-85096795

客服电话：4006000686

网址：www.nesc.cn

(49) 德邦证券有限责任公司

注册地址：上海市普陀区曹阳路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：方加春

联系人：叶蕾

电话：021-68761616

传真：021-68767981

客户服务电话：400-8888-128

网址：www.tebon.com.cn

(50) 华安证券有限责任公司

注册地址：安徽省合肥市长江中路 357 号

办公地址：安徽省合肥市阜南路 166 号润安大厦 A 座 24 层-32 层

法定代表人：李工

公司电话：0551-5161666

传真：0551-5161600

网址: www.hazq.com

客户服务电话: 96518、400-80-96518

(51) 上海证券有限责任公司

注册地址: 上海市西藏中路 336 号上海证券

办公地址: 上海市西藏中路 336 号

法定代表人: 郁忠民

联系人: 张瑾

电话: 021-53519888

传真: 021-53519888

网址: www.962518.com

客户服务电话: 4008918918、021-962518

(52) 方正证券有限责任公司

注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

公司地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人: 雷杰

全国统一客服热线: 95571

方正证券网站: www.foundersc.com

(53) 东海证券有限责任公司

注册地址: 江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

公司地址: 江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

法定代表人: 朱科敏

全国统一客服热线: 400-888-8588

东海证券网站: <http://www.longone.com.cn>

(54) 中航证券有限公司

注册地址: 江西省南昌市抚河北路 291 号

办公地址: 江西省南昌市抚河北路 291 号

法定代表人: 杜航

联系人: 戴蕾

联系电话: 0791-6768681

客服电话: 400-8866-567

公司网址：www.avicsec.com

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：通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

联系电话：(86 21) 3135 8666

传真：(86 21) 3135 8600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

名称：安永华明会计师事务所

法定代表人：葛明

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层

办公地址：上海市长乐路 989 号世纪商贸广场 23 楼

邮编：200031

公司电话：021-22288888（注：公司总机）

公司传真：021-22280000（注：传真总机）

签章会计师：徐艳，蒋燕华

业务联系人：蒋燕华

五、基金简介

基金名称：华宝兴业增强收益债券型证券投资基金

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、范围、策略、业绩比较基准和风险收益特征

1、投资目标

在控制风险和保持资产流动性的前提下，追求较高的当期收益和总回报，争取实现基金资产的

长期稳健增值。

2、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，包括公司债券、企业债券、可转换债券、短期融资券、金融债、资产支持证券、国债、央行票据、债券回购、股票、权证，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资于债券等固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%；投资于股票等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金可通过投资首次发行股票、增发新股、可转换债券转股票以及权证行权等方式获得股票，也可直接从二级市场买入股票。本基金可通过参与可分离转债申购而获得权证，也可直接从二级市场买入权证。

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。

3、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，通过宏观策略研究，对相关资产类别（包括固定收益类资产、权益类资产和货币资产等）的预期收益进行动态跟踪，决定其配置比例。

固定收益类资产中，本基金将主要通过大类资产配置、分类资产配置自上而下进行债券投资管理，以达到稳定收益和充分流动性的投资目标。

大类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、短期融资券等等。

(2) 债券投资策略（不含可转换债券）

本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期，结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。

首先，本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合的久期。

其次，债券投资组合的构建与调整是一个自下而上的过程，需综合评价各券收益率、波动性、

到期期限、票息、赋税条件、流动性、信用等级以及债券持有人结构等决定债券价值的影响因素。同时，本基金将运用系统化的定量分析技术和严格的投资管理制度等方法管理风险，通过久期、平均信用等级、个券集中度等指标，将组合的风险控制在合理的水平。在此基础上，通过各种积极投资策略的实施，追求组合较高的回报。主要运用的策略有：

1) 利率预期策略

基于对宏观经济环境的深入研究，预期未来市场利率的变化趋势，结合基金未来现金流的分析，确定投资组合平均剩余期限。如果预测未来利率将上升，则可以通过缩短组合平均剩余期限的办法规避利率风险，相反，如果预测未来利率下降，则延长组合平均剩余期限，赚取利率下降带来的超额回报。

2) 估值策略

通过比较债券的内在价值和市场价格而做出投资决策。当内在价值高于市场价格时，买入债券；当内在价值低于市场价格时，卖出债券。

3) 利差策略

基于不同债券市场板块间利差而在组合中分配资产的方法。收益率利差包括信用利差、可提前赎回和不可提前赎回证券之间的利差等表现形式。信用利差存在于不同债券市场，如国债和企业债利差、国债与金融债利差、金融债和企业债利差等；可提前赎回和不可提前赎回证券之间的利差形成的原因是基于利率预期的变动。

4) 互换策略

为加强对投资组合的管理，在卖出组合中部分债券的同时买入相似债券。该策略可以用来达到提高当期收益率或到期收益率、提高组合质量、减少税收等目的。

5) 信用分析策略

根据宏观经济运行周期阶段，分析债券发行人所处行业发展前景、发展状况、市场地位、财务状况、管理水平和债务水平等因素，评价债券发行人的信用风险，并根据特定债券的发行契约，评价债券的信用级别，确定债券的信用风险。

(3) 可转换债券投资策略

可转换债券同时具有债券、股票和期权的相关特性，结合了股票的长期增长潜力和债券的相对安全、收益固定的优势，并有利于从资产整体配置上分散利率风险并提高收益水平。本基金将重点从可转换债券的内在债券价值（如票面利息、利息补偿及无条件回售价格）、保护条款的适用范围、期权价值的大小、基础股票的质地和成长性、基础股票的流通性等方面进行研究，在公司自行开发的转债定价分析系统的支持下，充分发掘投资价值，并积极寻找各种套利机会，以获取更高的投

资收益。

(4) 资产支持证券投资策略

深入分析支持资产的构成及质量、发行条款等，进行积极投资。

(5) 新股申购投资策略

鉴于新股投资是目前国内低风险、高收益的投资品种之一，本基金将积极参与新股申购，增强收益。本基金将依靠公司投研系统，对新股进行深入分析，确定股票内在价值，结合市场估值水平，来预测上市价格，同时考虑市场利率水平及股票中签率，综合评估新股的投资价值，把握获利机会。

(6) 个股精选策略

采取定量与定性相结合的个股精选策略，使用成长、价值、盈利等方面的指标对股票进行排序，并对排名靠前的股票进行案头研究和实地调研，深入研究企业的基本面和长期发展前景，挑选出预期表现将超过大盘的个股，构建核心组合。

(7) 权证投资策略

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。

4、业绩比较基准

本基金业绩比较基准是中国债券总指数收益率 $\times 100\%$ 。

中国债券总指数由中央债券登记结算中心于 2003 年 1 月 1 日编制发布，样本涵盖交易所、银行间市场记帐式国债（固定、浮动利率）、金融债。中央国债登记结算有限公司将中国债券总指数情况于中国债券信息网（www.chinabond.com.cn）上公开发布。

从投资范围看，本基金主要投资于固定收益类金融工具，而中国债券总指数是目前涵盖范围最广的公开指数，涵盖了中国债券市场整体价格和投资回报情况；且指数样本是采集市场上真正在交易品种所制定出来的，有利于基金管理人以此总指数为基准进行投资组合的配置。因此，本基金选择中国债券总指数作为业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

5、风险收益特征

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金和股票型基金，高于货币

市场基金。在债券型基金产品中，其长期平均风险程度和预期收益率高于纯债券基金。

（二）投资程序

1、研究部负责投资研究和分析

宏观研究人员通过研究经济形势、经济政策（货币政策、财政政策、区域政策、产业政策等）等，撰写宏观研究报告，就基金的资产配置提出建议。

债券研究人员在预测未来利率走势的基础上，研究债券的收益率、风险特征和久期，对债券品种类别配置及个券投资提出具体建议。

行业研究人员根据数量化模型及对股票基本面的考察，确定对股票的投资建议。

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，定期将对债券和股票的分析结果提交给研究部、基金经理和投资决策委员会。

3、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，根据研究部、金融工程部和投资管理部提交的报告，就基金重大战略，包括组合资产配置、债券组合久期、债券类别配置等做出决策。

4、基金经理负责投资执行

基金经理在公司研究团队和风险评估小组的协助与支持下，向投资决策委员会提交投资计划，并在投资决策委员会确定的范围内，构建和调整投资组合，向交易部下达投资指令。

5、绩效评估

绩效评估人员利用相关工具对基金的投资风格、投资风险进行评估，测算经风险调整后的投资绩效，并对业绩贡献进行分析。

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) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；
- (3) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(4) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；

(5) 现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于 5%；

(6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(7) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(8) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(9) 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，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；

(10) 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定；

(11) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合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。其中因交易品种存在锁定期的原因，当股票等权益类资产合计超过基金净值的 20%，基金管理人将在相关交易品种锁定期满后 10 个交易日内调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

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。

七、基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至 2011 年 6 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

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（%）
1	权益投资	1,011,100.00	0.92
	其中：股票	1,011,100.00	0.92
2	固定收益投资	92,776,550.68	84.35
	其中：债券	92,776,550.68	84.35
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	7,864,208.95	7.15
6	其他资产	8,332,217.37	7.58
7	合计	109,984,077.00	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	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	1,011,100.00	0.93
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	540,250.00	0.50
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	470,850.00	0.43

C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,011,100.00	0.93

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	601208	东材科技	25,000	540,250.00	0.50
2	600216	浙江医药	15,000	470,850.00	0.43

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	55,154,560.00	50.79
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	26,572,778.90	24.47
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	11,049,211.78	10.17
8	其他	-	-
9	合计	92,776,550.68	85.43

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	010107	21国债(7)	261,770	26,962,310.00	24.83
2	010110	21国债(10)	150,000	14,973,000.00	13.79
3	122023	09万业债	91,340	9,518,541.40	8.76
4	010112	21国债(12)	85,000	8,478,750.00	7.81
5	112015	09泛海债	70,000	7,210,000.00	6.64

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

8、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) 本基金采取定量与定性相结合的个股精选策略，使用成长、价值、盈利等方面的指标对股票进行排序，并对排名靠前的股票进行案头研究和实地调研，深入研究企业的基本面和长期发展前景，挑选出预期表现将超过大盘的个股，构建核心组合，没有特定的股票备选库。

(3) 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	5,885,210.84
3	应收股利	-
4	应收利息	2,191,887.26
5	应收申购款	5,119.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,332,217.37

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110009	双良转债	4,300,242.70	3.96
2	113001	中行转债	4,223,200.00	3.89
3	126729	燕京转债	878,448.48	0.81
4	110078	澄星转债	816,820.20	0.75

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601208	东材科技	540,250.00	0.50	股东大会停牌
2	600216	浙江医药	470,850.00	0.43	临时停牌

八、基金的业绩

本基金业绩数据为截止 2011 年 6 月 30 日的的数据，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

1、华宝兴业增强收益债券 A:

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
2009/02/17—2009/12/31	5.80%	0.19%	-2.54%	0.06%	8.34%	0.13%
2010/01/01—2010/06/30	-0.93%	0.28%	2.01%	0.08%	-2.94%	0.20%
2010/01/01—2010/12/31	0.51%	0.28%	-0.87%	0.10%	1.38%	0.18%
2011/01/01—2011/06/30	-0.85%	0.21%	-0.43%	0.08%	-0.42%	0.13%
2009/02/17—2011/06/30	5.44%	0.23%	-3.81%	0.08%	9.25%	0.15%

2、华宝兴业增强收益债券 B:

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
2009/02/17—2009/12/31	5.43%	0.19%	-2.54%	0.06%	7.97%	0.13%
2010/01/01—2010/06/30	-1.13%	0.28%	2.01%	0.08%	-3.14%	0.20%
2010/01/01—2010/12/31	0.11%	0.28%	-0.87%	0.10%	0.98%	0.18%
2011/01/01—2011/06/30	-1.05%	0.21%	-0.43%	0.08%	-0.62%	0.13%
2009/02/17—2011/06/30	4.44%	0.23%	-3.81%	0.08%	8.25%	0.15%

(二) 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

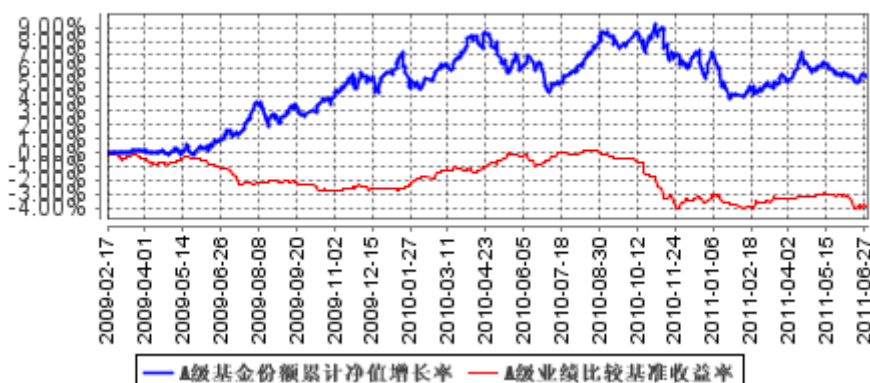
华宝兴业增强收益债券型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2009 年 2 月 17 日至 2011 年 6 月 30 日)

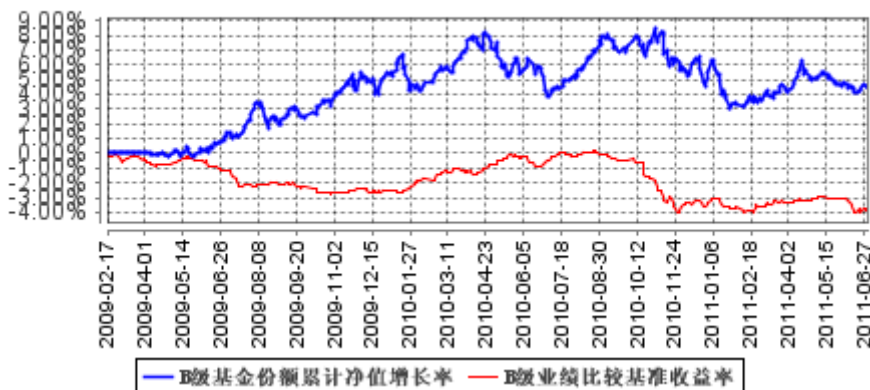
1、华宝兴业增强收益债券 A:

A级基金份额累计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



2、华宝兴业增强收益债券 B:

B级基金份额累计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



注：1、本基金基金合同生效于2009年2月17日，截止报告日本基金基金合同生效已满一年。2、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2009年8月16日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

九、基金费用

(一) 与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 销售服务费；
- (4) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- (5) 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- (6) 基金份额持有人大会费用；

(7) 基金的证券交易费用;

(8) 基金的银行汇划费用;

(9) 按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H=E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

(3) 基金的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售费,本基金 B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%,本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务,基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费按前一日 B 类份额的基金资产净值的 0.4%年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为基金每日应计提的销售服务费

E 为前一日 B 类份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送

基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述一、基金费用的种类中第 4—9 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- (1) 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- (2) 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- (3) 《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- (4) 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

4、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

(二) 与基金销售有关的费用

1、申购费和赎回费

(1) 申购费

本基金 A 类基金份额采用前端收费模式收取基金申购费用。投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。本基金 B 类基金份额不收取申购费。

本基金 A 类基金份额的申购费率表如下：

申购金额	申购费率
500 万（含）以上	每笔 1000 元
大于等于 200 万，小于 500 万	0.2%
大于等于 100 万，小于 200 万	0.4%
大于等于 50 万，小于 100 万	0.6%
50 万以下	0.8%

本基金的申购费用由申购人承担，主要用于市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

(2) 赎回费

本基金 A 类基金份额的最高赎回费率不超过 5%，赎回费随基金持有时间的增加而递减。本基金 B 类基金份额不收取赎回费。

本基金 A 类基金份额的赎回费率表如下：

持有时间	费率
两年以内	0.3%
两年以上（含两年）	0%

本基金 A 类基金份额的赎回费用由基金份额持有人承担，其中 25% 的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

(3) 基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施 2 个工作日前在至少一种中国证监会指定媒体上刊登公告。

(4) 基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，也可针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

2、申购份额与赎回金额的计算方式

(1) 申购份额的计算方式

1) A 类基金份额的申购份额计算方式

净申购金额 = 申购金额 / [1 + 申购费率]

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日 A 类基金份额净值

申购费用、净申购金额的计算按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。申购份额的计算结果保留小数点后两位，两位以后舍去，舍去部分所代表的资产归基金财产所有。

2) B 类基金份额的申购份额计算方式

申购份额 = 申购金额 / 申购当日 B 类基金份额净值

申购份额的计算结果保留小数点后两位，两位以后舍去，舍去部分所代表的资产归基金财产所有。

(2) 赎回金额的计算方式

1) A类基金份额的赎回金额计算方式

赎回总额=赎回份额×赎回当日A类基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

净赎回金额=赎回总额-赎回费用

各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

2) B类基金份额的赎回金额计算方式

赎回金额=赎回份数×赎回当日B类基金份额净值

赎回金额的计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

(3) T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告。

A类基金份额净值=A类基金份额的基金资产净值/发售在外的A类基金份额总数

B类基金份额净值=B类基金份额的基金资产净值/发售在外的B类基金份额总数

遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

(4) 本基金份额净值的计算，保留到小数点后四位，小数点后第五位四舍五入，由此产生的误差在基金财产中列支。

3、转换费

(1) 开通转换的机构

本公司直销柜台、直销e网金、中国银行、中国建设银行、招商银行、民生银行、交通银行、中信银行、申银万国证券、联合证券、光大证券、招商证券、平安证券、国泰君安证券、中信金通证券、中信建投证券、兴业证券、长江证券、广发证券、海通证券、中投证券、东吴证券、中信证券、华泰证券、恒泰证券、渤海证券、东海证券已开通本基金与本公司管理的宝康系列基金、多策略增长基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、大盘精选基金间的转换业务。

本公司直销柜台、直销e网金、中国建设银行、中国银行、招商银行、民生银行、中信银行、交通银行、深发展银行、浦发银行、兴业银行、江苏银行、渤海银行、华夏银行、华泰联合证券、国泰君安证券、中信建投证券、长江证券、海通证券、招商证券、申银万国证券、银河证券、广发证券、兴业证券、中信证券、光大证券、平安证券、国信证券、中信万通证券、长城证券、渤海证券、安信证券、华宝证券、中金公司、齐鲁证券、广发华福证券、信达证券、江海证券、国都证券、

东吴证券和东海证券已开通本基金与中证 100 指数基金（前端模式）的转换。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国建设银行、中国银行、中国农业银行、交通银行、招商银行、中国民生银行、中信银行、深圳发展银行、上海浦东发展银行、广东发展银行、江苏银行、华夏银行、渤海银行、华泰联合证券、国泰君安证券、海通证券、申银万国证券、光大证券、东兴证券、华泰证券、东海证券已开通本基金与上证 180 价值 ETF 联接基金的转换。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国建设银行、中国银行、中国农业银行、交通银行、招商银行、中国民生银行、中信银行、深圳发展银行、浦发银行、渤海银行、江苏银行、华夏银行、申银万国证券、国泰君安、光大证券、海通证券、中国银河证券、中信建投证券、招商证券、广发证券、长江证券、华泰联合证券、中信金通证券、中信万通证券、平安证券、东方证券、兴业证券、华泰证券、中银国际证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、东吴证券、中信证券、江海证券、安信证券、中金公司、华宝证券、华安证券、齐鲁证券、广发华福证券、信达证券、国都证券、东兴证券、东北证券、德邦证券、上海证券、方正证券券已开通本基金与新兴产业基金的转换。

本公司直销柜台、直销 e 网金、招商银行、中国建设银行、中国银行、交通银行、中国民生银行、中信银行、深圳发展银行、上海浦东发展、兴业银行、江苏银行、渤海银行、国泰君安证券、光大证券、海通证券、中国银河证券、中信建投证券、招商证券、广发证券、长江证券、东吴证券、华泰联合证券、申银万国证券、平安证券、中信证券、东方证券、兴业证券、中信金通证券、国信证券、华泰证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、中国建银投资证券、安信证券、中金公司、华宝证券、齐鲁证券、广发华福证券、信达证券、江海证券、国都证券、东北证券、德邦证券、华安证券、上海证券、东海证券已开通本基金与可转债基金的转换。

基金转换只能在同一销售机构进行，转换的两只基金必须都是该销售机构代理销售的本公司管理的基金。其他销售机构基金转换业务的具体办理时间、流程以销售机构及其网点的安排和规定为准。

（2）转换费

本基金与公司管理的其他基金间的转换，转换费用由二部分组成：转出基金赎回费和转入基金与转出基金的申购补差费。

赎回费：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。其中 25%归转出基金基金财产，其余作为注册登记费和相关的手续费。由于本基金 B 类基金份额的赎回费为零，则从 B 类基金份额转出，将不收取赎回费。

申购补差费：按照转入基金与转出基金的申购费率的差额收取补差费。转出基金金额所对应的转出基金申购费率低于转入基金的申购费率的，补差费率为转入基金和转出基金的申购费率差额；

转出基金金额所对应的转出基金申购费率高于转入基金的申购费率的，补差费为零。由于本基金 B 类基金份额的申购费为零，则从 B 类基金份额转入其他基金，对应的申购补差费率即为转入基金的对应申购费率。

计算基金转换费用所涉及的赎回费率和申购费率均按正常费率执行。本基金的两类基金份额之间不可转换。

(3) 基金转换公式

1) 基金转换公式为：

转出费用=转出份额*基金单位净值*赎回费率

转出总金额=转出份额*基金单位净值

净转出金额=转出总金额-转出费用

净转入金额=净转出金额/（1+补差费率）

（补差费率=转出申购费率与转入申购费率差）

补差费=净转出金额-净转入金额

2) 基金管理人在不损害本基金份额持有人权益的情况下可更改上述公式，但应最迟在新的公式适用前 3 个工作日予以公告。

十、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人有权根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目及内容。主要服务内容如下：

(一) 资料寄送

投资人更改个人信息资料，请及时到原开立华宝兴业基金账户的销售网点更改。

在从销售机构获取准确的客户地址和邮编的前提下，基金管理人将负责寄送以下资料：

1、开户确认书

在基金募集期间开户的，于基金合同生效后的十个工作日内向投资人寄送开户确认书。存续期间，在每个季度结束后15个工作日内向投资人寄送(通过中国银行首次购买本基金管理人旗下基金的基金份额持有人除外)。

2、基金投资人对账单

基金投资人对账单包括季度对账单与年度对账单。在每季度结束后的15个工作日内向该季度有交易的基金份额持有人以书面或电子文件形式寄送，年度对账单在每年度结束后15个工作日内对本基金的所有份额持有人以书面或电子文件形式寄送(通过中国银行首次购买本基金管理人旗下基金

的基金份额持有人除外)。

3、其他相关的信息资料

(二) 红利再投资

本基金收益分配时,基金份额持有人可以选择将所获红利再投资于本基金,登记注册机构将其所获红利按分红实施日的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资免收申购费用。

(三) 定期定额投资计划

1、定义

本基金的 " 定期定额投资计划 " 是指投资人可通过本基金管理人指定的销售机构提交申请,约定每月扣款时间、扣款金额,由指定的销售机构于每月约定扣款日在投资人指定资金账户内自动完成扣款和基金申购申请的一种长期投资方式。投资者在办理本业务的同时,仍然可以进行日常申购、赎回业务。

2、办理时间

本业务申请受理时间为开放式基金法定开放日 9:30—15:00。

3、办理场所

目前,本公司直销 e 网金、中国银行、中国农业银行、中国民生银行、中信银行、深圳发展银行、上海浦东发展银行、兴业银行、广发银行、江苏银行、华夏银行、渤海银行、华泰联合证券、国泰君安证券、中信建投证券、海通证券、招商证券、中国银河证券、东吴证券、光大证券、平安证券、安信证券、华宝证券、齐鲁证券、广发华福证券、江海证券、德邦证券、华安证券、东北证券、申银万国证券、中信证券已开通本基金的定期定额投资业务。

本公司新增其他销售机构开办此业务时,将另行公告。

4、扣款金额

投资者可与各代销机构约定每月固定扣款金额,最低扣款金额应遵循各代销机构的规定。本公司直销 e 网金、中国银行、中国农业银行、中信银行、深圳发展银行、兴业银行、广发银行、江苏银行、华夏银行、渤海银行、华泰联合证券、国泰君安证券、中信建投证券、海通证券、招商证券、中国银河证券、东吴证券、光大证券、平安证券、安信证券、华宝证券、广发华福证券、江海证券、华安证券、东北证券、中信证券的扣款金额为每月不低于人民币 200 元(含申购费),上海浦东发展银行和德邦证券的扣款金额为每月不低于人民币 300 元(含申购费),齐鲁证券、申银万国证券的扣款金额为每月不低于人民币 500 元(含申购费)。

(四) 基金转换

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国银行、中国建设银行、招商银行、民生银行、交通银行、

中信银行、申银万国证券、联合证券、光大证券、招商证券、平安证券、国泰君安证券、中信金通证券、中信建投证券、兴业证券、长江证券、广发证券、海通证券、中投证券、东吴证券、中信证券、华泰证券、恒泰证券、渤海证券、东海证券已开通本基金与本公司管理的宝康系列基金、多策略增长基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、大盘精选基金间的转换业务。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国建设银行、中国银行、招商银行、民生银行、中信银行、交通银行、深发展银行、浦发银行、兴业银行、江苏银行、渤海银行、华夏银行、华泰联合证券、国泰君安证券、中信建投证券、长江证券、海通证券、招商证券、申银万国证券、银河证券、广发证券、兴业证券、中信证券、光大证券、平安证券、国信证券、中信万通证券、长城证券、渤海证券、安信证券、华宝证券、中金公司、齐鲁证券、广发华福证券、信达证券、江海证券、国都证券、东吴证券和东海证券已开通本基金与中证 100 指数基金（前端模式）的转换。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国建设银行、中国银行、中国农业银行、交通银行、招商银行、中国民生银行、中信银行、深圳发展银行、上海浦东发展银行、广东发展银行、江苏银行、华夏银行、渤海银行、华泰联合证券、国泰君安证券、海通证券、申银万国证券、光大证券、东兴证券、华泰证券和东海证券已开通本基金与上证 180 价值 ETF 联接基金的转换。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国建设银行、中国银行、中国农业银行、交通银行、招商银行、中国民生银行、中信银行、深圳发展银行、浦发银行、渤海银行、江苏银行、华夏银行、申银万国证券、国泰君安、光大证券、海通证券、中国银河证券、中信建投证券、招商证券、广发证券、长江证券、华泰联合证券、中信金通证券、中信万通证券、平安证券、东方证券、兴业证券、华泰证券、中银国际证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、东吴证券、中信证券、江海证券、安信证券、中金公司、华宝证券、华安证券、齐鲁证券、广发华福证券、信达证券、国都证券、东兴证券、东北证券、德邦证券、上海证券、方正证券券已开通本基金与新兴产业基金的转换。

本公司直销柜台、直销 e 网金、招商银行、中国建设银行、中国银行、交通银行、中国民生银行、中信银行、深圳发展银行、上海浦东发展、兴业银行、江苏银行、渤海银行、国泰君安证券、光大证券、海通证券、中国银河证券、中信建投证券、招商证券、广发证券、长江证券、东吴证券、华泰联合证券、申银万国证券、平安证券、中信证券、东方证券、兴业证券、中信金通证券、国信证券、华泰证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、中国建银投资证券、安信证券、中金公司、华宝证券、齐鲁证券、广发华福证券、信达证券、江海证券、国都证券、东北证券、德邦证券、华安证券、上海证券、东海证券已开通本基金与可转债基金的转换。

基金转换只能在同一销售机构进行，转换的两只基金必须都是该销售机构代理销售的本公司管

理的基金。其他销售机构基金转换业务的具体办理时间、流程以销售机构及其网点的安排和规定为准。

(五) 在线服务

基金管理人利用自己的网站（www.fsfund.com）为基金投资人提供网上查询、网上资讯服务。

(六) 资讯服务

1、投资人如果了解申购与赎回的交易情况、基金账户份额、基金产品与服务等信息，可拨打华宝兴业基金管理有限公司如下电话：

电话呼叫中心：4007005588，021-38924558该电话可转人工座席。

直销柜台电话：021-38505888-301或302、38505731、38505732

传真：021-50499663，50499667、50988055

2、互联网站

公司网址：www.fsfund.com

电子信箱：fsf@fsfund.com

(七) 客户投诉和建议处理

投资人可以通过基金管理人提供的呼叫中心自动语音留言、呼叫中心人工座席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。投资人还可以通过代销机构的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉。

十一、《招募说明书》更新部分的说明

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）及其他有关规定，华宝兴业基金管理有限公司对《华宝兴业增强收益债券型证券投资基金招募说明书》作如下更新：

- 1、“三、基金管理人”部分“(一)基金管人概况”更新了相关的信息及“(二)主要人员情况”更新了公司主要人员信息。
- 2、“四、基金托管人”部分更新了托管人的情况和信息。
- 3、“五、相关服务机构”部分更新了代销机构的相关信息。
- 4、“九、与基金管理人管理的其他基金转换”部分“(二)基金转换受理场所”更新了相关的信息。
- 5、“十、基金的投资”部分增加了截至2011年6月30日的基金的投资组合报告。

- 6、 “十一、基金的业绩”部分增加了截至 2011 年 6 月 30 日的基金业绩数据。
- 7、 “二十三、对基金份额持有人的服务”部分“(四)基金转换”更新了相关内容。
- 8、 “二十四、其他应披露事项”部分，对本报告期内的相关公告作了信息披露。

上述内容仅为摘要,须与本《招募说明书》后面所载之详细资料一并阅读。

华宝兴业基金管理有限公司

2011 年 9 月 24 日