

# 华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金招募说明书(更新)摘要

2012年第1号

**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**

华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会2003年4月18日证监基金字[2003]101号文核准注册,基金合同于2003年5月15日正式生效。本基金管理人华宝兴业基金管理有限公司(以下简称“本公司”)经中国证监会核准,负责本基金的募集、投资、赎回、申购、转换、非交易过户、转托管、定期定额投资等业务。本基金的托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。本招募说明书(更新)所载内容截止日为2012年11月15日,有关财务数据和净值表现数据截止日为2012年11月31日,财务数据未经审计。

人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老金和其他养老基金在内的托管业务格局。目前中国托管业务规模居全球前列,业务品种齐全。截至2011年6月30日,中国建设银行已托管195只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。2010年,中国建设银行荣获由英国《金融时报》颁发的“2009年度全球最佳托管银行”(Domestic Top Rated),并连续三年荣获“财资杂志”为“中国最佳托管银行”。

二、基金托管人的内部控制制度  
 (一)基金托管人的内部风险控制制度概况  
 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控制度,守法经营,规范运作,严格监督,确保业务稳健运行,保证基金财产的安全完整,维护基金份额持有人的合法权益,确保托管业务的正常进行。  
 (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,对托管业务的风险控制实施总体监督。托管部专门设置了稽核团队,配备了专职内控稽核人员负责托管业务的内控监督工作,具有独立行使稽核稽核工作和报告能力。  
 (三)内部控制制度及措施  
 中国建设银行托管部制定了完备的制度控制体系,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,业务操作严格实行复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按专人保管,业务授权严格按照规定程序执行,严格控制基金投资组合证券的交易和资金调拨等行为的合规性;信息系统具有防止篡改、病毒发作影响信息系统服务,防止信息从计算机溢露、泄露和非法使用,防止信息丢失;业务人员严格执行内控制度,确保托管资产的安全与完整。  
 (四)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》及其他法律法规和基金合同的约定,基金托管人对基金管理人的投资运作,利用自行开发的“基金托管业务系统—基金监督子系统”,严格按照法律法规及基金合同的规定,对基金管理人编制的基金资产净值计算、基金份额申购赎回、基金投资收益分配、基金资产估值、基金管理人报酬等进行复核,对基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金投资人的投资行为进行监督,对基金管理人、基金托管人、基金销售机构的违规行为进行提示,对基金管理人、基金托管人、基金销售机构的违规行为进行报告,对基金管理人、基金托管人、基金销售机构的违规行为进行报告,对基金管理人、基金托管人、基金销售机构的违规行为进行报告。

(二)认购、申购和赎回  
 1. 投资目标  
 本基金为主动型基金,降低投资组合波动性,提高投资组合的长期回报。  
 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、债券以及中国证监会批准并允许投资的其它金融工具。  
 债券投资方面,主要投资交易所和银行间债券市场上的各类债券,包括国债、金融债、企业债、可转债等。股票投资方面,主要投资于A股上市180指数、沪深300指数的成分股。  
 3. 投资策略  
 (1)资产配置策略  
 根据市场环境,灵活运用资产配置策略,根据市场大势,适时调整,在追求基金资产长期增值的基础上,力争超越业绩比较基准。  
 (2)股票投资策略  
 本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法,在充分研究宏观经济、行业状况和个股特征的基础上,精选具有良好成长性的股票进行投资。本基金采用定量分析和定性分析相结合的方法,对股票投资组合进行动态调整,在追求基金资产长期增值的基础上,力争超越业绩比较基准。  
 (3)债券投资策略  
 本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法,在充分研究宏观经济、行业状况和个股特征的基础上,精选具有良好成长性的股票进行投资。本基金采用定量分析和定性分析相结合的方法,对股票投资组合进行动态调整,在追求基金资产长期增值的基础上,力争超越业绩比较基准。  
 (4)衍生品投资策略  
 本基金将根据风险管理原则,以套期保值为目的,有选择性地投资于国债期货、股指期货、权证等金融衍生品。本基金将采取套期保值策略,以规避投资组合中的系统性风险,提高投资组合的流动性,降低投资组合波动性,提高投资组合的长期回报。  
 (5)其他金融工具投资策略  
 本基金将根据风险管理原则,有选择性地投资于国债期货、股指期货、权证等金融衍生品。本基金将采取套期保值策略,以规避投资组合中的系统性风险,提高投资组合的流动性,降低投资组合波动性,提高投资组合的长期回报。

序号	债券	品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	国债	31,741,541.50	1.36
2	央行票据	央行票据	361,287,000.00	14.33
3	金融债	金融债	172,049,000.00	6.81
4	企业债	企业债	172,049,000.00	6.81
5	中期票据	中期票据	4,729,000.00	0.19
6	可转债	可转债	-	-
7	合计	合计	570,406,541.50	22.58

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	100147	10央行票据47	1,000,000	98,880,000.00	3.91
2	100179	10央行票据79	1,000,000	98,640,000.00	3.90
3	110128	11央行票据28	1,000,000	96,730,000.00	3.83
4	110182	11央行票据82	700,000	67,627,000.00	2.68
5	080115	08央行15	500,000	59,380,000.00	2.31

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	110101	11央行票据01	9,743,002.30	0.38	
2	110128	11央行票据28	7,789,301.52	0.31	
3	110182	11央行票据82	164,361.86	0.01	
4	080115	08央行15	59,380,000.00	2.31	
5	080127	08央行27	59,380,000.00	2.31	
6	080131	08央行31	59,380,000.00	2.31	
7	080135	08央行35	59,380,000.00	2.31	
8	080139	08央行39	59,380,000.00	2.31	
9	080143	08央行43	59,380,000.00	2.31	
10	080147	08央行47	59,380,000.00	2.31	
11	080151	08央行51	59,380,000.00	2.31	
12	080155	08央行55	59,380,000.00	2.31	
13	080159	08央行59	59,380,000.00	2.31	
14	080163	08央行63	59,380,000.00	2.31	
15	080167	08央行67	59,380,000.00	2.31	
16	080171	08央行71	59,380,000.00	2.31	
17	080175	08央行75	59,380,000.00	2.31	
18	080179	08央行79	59,380,000.00	2.31	
19	080183	08央行83	59,380,000.00	2.31	
20	080187	08央行87	59,380,000.00	2.31	
21	080191	08央行91	59,380,000.00	2.31	
22	080195	08央行95	59,380,000.00	2.31	
23	080199	08央行99	59,380,000.00	2.31	
24	090001	09国债01	1,000,000	98,880,000.00	3.91
25	090002	09国债02	1,000,000	98,640,000.00	3.90
26	090003	09国债03	1,000,000	96,730,000.00	3.83
27	090004	09国债04	700,000	67,627,000.00	2.68
28	090005	09国债05	500,000	59,380,000.00	2.31
29	090006	09国债06	500,000	59,380,000.00	2.31
30	090007	09国债07	500,000	59,380,000.00	2.31
31	090008	09国债08	500,000	59,380,000.00	2.31
32	090009	09国债09	500,000	59,380,000.00	2.31
33	090010	09国债10	500,000	59,380,000.00	2.31
34	090011	09国债11	500,000	59,380,000.00	2.31
35	090012	09国债12	500,000	59,380,000.00	2.31
36	090013	09国债13	500,000	59,380,000.00	2.31
37	090014	09国债14	500,000	59,380,000.00	2.31
38	090015	09国债15	500,000	59,380,000.00	2.31
39	090016	09国债16	500,000	59,380,000.00	2.31
40	090017	09国债17	500,000	59,380,000.00	2.31
41	090018	09国债18	500,000	59,380,000.00	2.31
42	090019	09国债19	500,000	59,380,000.00	2.31
43	090020	09国债20	500,000	59,380,000.00	2.31
44	090021	09国债21	500,000	59,380,000.00	2.31
45	090022	09国债22	500,000	59,380,000.00	2.31
46	090023	09国债23	500,000	59,380,000.00	2.31
47	090024	09国债24	500,000	59,380,000.00	2.31
48	090025	09国债25	500,000	59,380,000.00	2.31
49	090026	09国债26	500,000	59,380,000.00	2.31
50	090027	09国债27	500,000	59,380,000.00	2.31
51	090028	09国债28	500,000	59,380,000.00	2.31
52	090029	09国债29	500,000	59,380,000.00	2.31
53	090030	09国债30	500,000	59,380,000.00	2.31
54	090031	09国债31	500,000	59,380,000.00	2.31
55	090032	09国债32	500,000	59,380,000.00	2.31
56	090033	09国债33	500,000	59,380,000.00	2.31
57	090034	09国债34	500,000	59,380,000.00	2.31
58	090035	09国债35	500,000	59,380,000.00	2.31
59	090036	09国债36	500,000	59,380,000.00	2.31
60	090037	09国债37	500,000	59,380,000.00	2.31
61	090038	09国债38	500,000	59,380,000.00	2.31
62	090039	09国债39	500,000	59,380,000.00	2.31
63	090040	09国债40	500,000	59,380,000.00	2.31
64	090041	09国债41	500,000	59,380,000.00	2.31
65	090042	09国债42	500,000	59,380,000.00	2.31
66	090043	09国债43	500,000	59,380,000.00	2.31
67	090044	09国债44	500,000	59,380,000.00	2.31
68	090045	09国债45	500,000	59,380,000.00	2.31
69	090046	09国债46	500,000	59,380,000.00	2.31
70	090047	09国债47	500,000	59,380,000.00	2.31
71	090048	09国债48	500,000	59,380,000.00	2.31
72	090049	09国债49	500,000	59,380,000.00	2.31
73	090050	09国债50	500,000	59,380,000.00	2.31
74	090051	09国债51	500,000	59,380,000.00	2.31
75	090052	09国债52	500,000	59,380,000.00	2.31
76	090053	09国债53	500,000	59,380,000.00	2.31
77	090054	09国债54	500,000	59,380,000.00	2.31
78	090055	09国债55	500,000	59,380,000.00	2.31
79	090056	09国债56	500,000	59,380,000.00	2.31
80	090057	09国债57	500,000	59,380,000.00	2.31
81	090058	09国债58	500,000	59,380,000.00	2.31
82	090059	09国债59	500,000	59,380,000.00	2.31
83	090060	09国债60	500,000	59,380,000.00	2.31
84	090061	09国债61	500,000	59,380,000.00	2.31
85	090062	09国债62	500,000	59,380,000.00	2.31
86	090063	09国债63	500,000	59,380,000.00	2.31
87	090064	09国债64	500,000	59,380,000.00	2.31
88	090065	09国债65	500,000	59,380,000.00	2.31
89	090066	09国债66	500,000	59,380,000.00	2.31
90	090067	09国债67	500,000	59,380,000.00	2.31
91	090068	09国债68	500,000	59,380,000.00	2.31
92	090069	09国债69	500,000	59,380,000.00	2.31
93	090070	09国债70	500,000	59,380,000.00	2.31
94	090071	09国债71	500,000	59,380,000.00	2.31
95	090072	09国债72	500,000	59,380,000.00	2.31
96	090073	09国债73	500,000	59,380,000.00	2.31
97	090074	09国债74	500,000	59,380,000.00	2.31
98	090075	09国债75	500,000	59,380,000.00	2.31
99	090076	09国债76	500,000	59,380,000.00	2.31
100	090077	09国债77	500,000	59,380,000.00	2.31
101	090078	09国债78	500,000	59,380,000.00	2.31
102	090079	09国债79	500,000	59,380,000.00	2.31
103	090080	09国债80	500,000	59,380,000.00	2.31
104	090081	09国债81	500,000	59,380,000.00	2.31
105	090082	09国债82	500,000	59,380,000.00	2.31
106	090083	09国债83	500,000	59,380,000.00	2.31
107	090084	09国债84	500,000	59,380,000.00	2.31
108	090085	09国债85	500,000	59,380,000.00	2.31
109	090086	09国债86	500,000	59,380,000.00	2.31
110	090087	09国债87	500,000	59,380,000.00	2.31
111	090088	09国债88	500,000	59,380,000.00	2.31
112	090089	09国债89	500,000	59,380,000.00	2.31
113	090090	09国债90	500,000	59,380,000.00	2.31
114	090091	09国债91	500,000	59,380,000.00	2.31
115	090092	09国债92	500,000	59,380,000.00	2.31
116	090093	09国债93	500,000	59,380,000.00	2.31
117	090094	09国债94	500,000	59,380,000.00	2.31
118	090095	09国债95	500,000	59,380,000.00	2.31
119	090096	09国债96	500,000	59,380,000.00	2.31
120	090097	09国债97	500,000	59,380,000.00	2.31
121	090098	09国债98	500,000	59,380,000.00	2.31
122	090099	09国债99	500,000	59,380,000.00	2.31
123	090100	09国债100	500,000	59,380,000.00	2.31

序号	债券代码	债券名称	
----	------	------	--