

# **华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金 2006 年半年度报告**

**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**

**报告送出日期：2006 年 8 月 24 日**

### **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。本半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 2006 年 8 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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 6 月 30 日。

**本报告中有关财务资料未经审计。**

## 目 录

|                              |           |
|------------------------------|-----------|
| <b>第一章 基金简介</b>              | <b>4</b>  |
| 1. 基金运作方式                    | 4         |
| 2. 基金管理人、托管人及基金合同生效日期        | 4         |
| 3. 基金名称、交易代码及基金份额            | 4         |
| 4. 基金投资目标、投资策略、业绩比较基准及风险收益特征 | 4         |
| 5. 基金管理人有关情况                 | 5         |
| 6. 基金托管人有关情况                 | 6         |
| 7. 基金信息披露媒体及其他               | 6         |
| 8. 基金注册登记机构                  | 6         |
| <b>第二章 基金主要财务指标和基金净值表现</b>   | <b>6</b>  |
| 1. 主要会计数据和财务指标               | 7         |
| 2. 净值增长率与同期比较基准收益率比较         | 7         |
| 3. 基金累计净值增长率与比较基准收益率走势对比     | 7         |
| <b>第三章 基金管理人报告</b>           | <b>8</b>  |
| 1. 基金经理简介                    | 8         |
| 2. 基金遵规守信情况说明                | 8         |
| 3. 基金经理报告                    | 8         |
| <b>第四章 托管人报告</b>             | <b>9</b>  |
| <b>第五章 财务会计报告</b>            | <b>9</b>  |
| 1. 基金比较式资产负债表                | 9         |
| 2. 基金比较式经营业绩及收益分配表           | 10        |
| 3. 基金比较式净值变动表                | 11        |
| 4. 会计报表附注                    | 12        |
| <b>第六章 投资组合报告</b>            | <b>16</b> |
| 1. 基金资产组合                    | 16        |
| 2. 按行业分类的股票投资组合              | 17        |
| 3. 基金投资股票明细                  | 18        |
| 4. 股票投资组合重大变动                | 19        |
| 5. 按券种分类的债券投资组合              | 21        |
| 6. 基金债券投资前 5 名明细             | 21        |
| 7. 基金资产支持证券投资明细              | 21        |
| 8. 投资组合报告附注                  | 21        |
| <b>第七章 基金份额持有人户数、持有人结构</b>   | <b>22</b> |
| <b>第八章 基金份额变动情况</b>          | <b>22</b> |
| <b>第九章 重大事件揭示</b>            | <b>22</b> |
| <b>第十章 备查文件目录</b>            | <b>24</b> |

## 第一章 基金简介

### 1. 基金运作方式

华宝兴业多策略增长开放式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

华宝兴业多策略增长开放式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，2004 年 4 月 30 日募集结束并于 2004 年 5 月 11 日基金合同正式生效。

### 3. 基金名称、交易代码及基金份额

基金的名称、简称、交易代码、本报告期末（截止 2006 年 6 月 30 日）基金份额总额列表如下：

| 基金名称                   | 简称    | 交易代码   | 期末基金份额总额（份）      |
|------------------------|-------|--------|------------------|
| 华宝兴业多策略增长<br>开放式证券投资基金 | 多策略增长 | 240005 | 1,047,108,249.61 |

### 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：**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。

**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

##### A、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。当某一风格板块投资机会较大时，增加对该板块的持有比例；当某一板块投资机会较小时，减少对该板块的持有比例。

##### B、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。

a、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。

b、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。

c、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账面价值出售；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。

d、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

A、本基金定位为股票基金；在政策允许的情况下，本基金债券投资的下限为零；

B、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；

C、本基金投资债券将采取稳健的投资策略。

**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

## 风险收益特征：

本基金是一只积极型的股票基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。本基金力争使基金的单位风险收益值从长期平均来看高于业绩比较基准的单位风险收益值。

## 5. 基金管理人有关情况

名称：华宝兴业基金管理有限公司

注册地址：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

邮政编码：200121

法定代表人：郑安国

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”）

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一号院一号楼

邮政编码：100032

法定代表人：郭树清

信息披露负责人：尹东

联系电话：010—67595104

传真：010—66275853

电子信箱：yindong@ccb.cn

## 7. 基金信息披露媒体及其他

本基金选定的信息披露报纸包括：中国证券报、上海证券报、证券时报

本基金登载半年报正文的互联网网址：[www.fsfund.com](http://www.fsfund.com)

本基金半年报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。

## 8. 基金注册登记机构

本基金的注册登记机构为基金管理人，办公地址等有关情况与基金管理人一致。

## 第二章 基金主要财务指标和基金净值表现

本基金自 2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日主要财务数据和基金净值表现如下。

## 1. 主要会计数据和财务指标

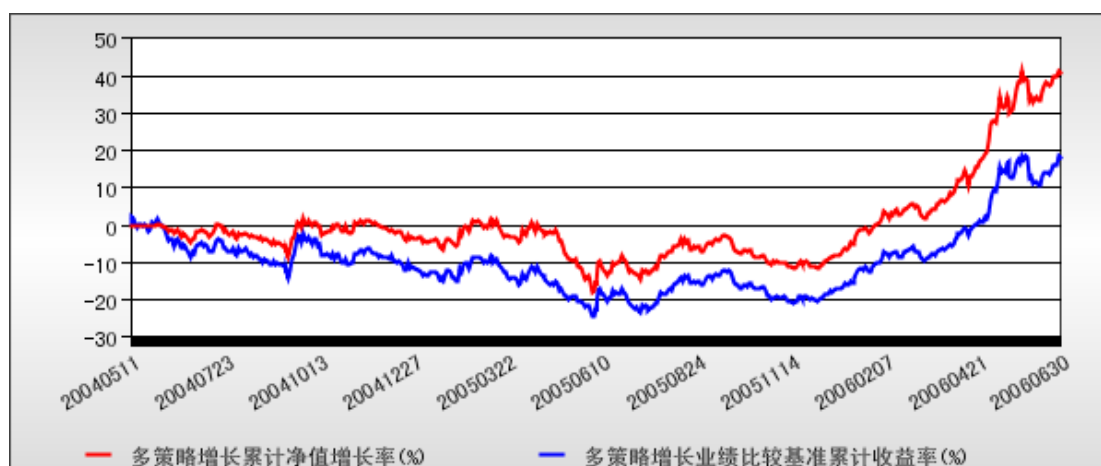
金额单位：人民币元

| 项 目          | 2006年6月30日       |
|--------------|------------------|
| 基金本期净收益      | 585,838,283.94   |
| 基金份额本期净收益    | 0.3065           |
| 期末可供分配基金收益   | 276,240,264.31   |
| 期末可供分配基金份额收益 | 0.2638           |
| 期末基金资产净值     | 1,338,675,842.80 |
| 期末基金份额净值     | 1.2785           |
| 基金加权平均净值收益率  | 28.32%           |
| 本期基金份额净值增长率  | 48.56%           |
| 基金份额累计净值增长率  | 41.07%           |

## 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  | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | -      | -      |
|------------|--------|----------|-----------|--------------|--------|--------|
| 过去 1 个月    | 1.92%  | 1.30%    | 1.58%     | 1.40%        | 0.34%  | -0.10% |
| 过去 3 个月    | 29.64% | 1.34%    | 24.86%    | 1.36%        | 4.78%  | -0.02% |
| 过去 6 个月    | 48.56% | 1.11%    | 39.97%    | 1.11%        | 8.59%  | 0.00%  |
| 过去 1 年     | 58.43% | 0.97%    | 47.33%    | 0.99%        | 11.10% | -0.02% |
| 自基金合同生效日至今 | 41.07% | 1.00%    | 18.36%    | 1.09%        | 22.71% | -0.09% |

## 3. 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，自基金合同生效日期的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。

本章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,开放式基金的申购赎回费、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

本公司是 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司。多策略增长基金是本公司管理的第二只开放式证券投资基金。本公司还管理有华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金、华宝兴业现金宝货币市场基金、华宝兴业动力组合股票型证券投资基金以及华宝兴业收益增长混合型证券投资基金,分别成立于 2003 年 7 月 15 日、2005 年 3 月 31 日、2005 年 11 月 17 日和 2006 年 6 月 15 日。截至 2006 年 6 月 30 日,本公司管理的开放式证券投资基金资产净值合计 9,205,827,943.89 元。

#### 1. 基金经理简介

余荣权先生,经济学硕士,曾任深圳赛格集团财务公司投资部经理,华宝信托投资有限责任公司投资管理部总经理,2003 年 3 月加入华宝兴业基金管理有限公司,任投资总监,2003 年 7 月至 2004 年 5 月兼任宝康灵活配置开放式证券投资基金基金经理,2006 年 4 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、《华宝兴业多策略增长开放式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。

由于申购赎回引起的基金资产规模变化,华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金短期内出现过投资总比例略低于 80%的情况。发生此类情况后,基金在合理期限内进行了调整,没有给投资人带来额外风险或损失。

#### 3. 基金经理报告

经济的持续高速增长、估值水平的偏低及股权分置改革的顺利推进使 A 股市在上半年走出一拨强劲的上升行情,年初地产、金融、食品饮料及有色等行业表现出色,随后机械、军工、券商概念及津滨概念股走强,反映出市场心态从熊市到牛市的演变,即市场偏好从价值型股票到成长型股票再到概念型股票的变化,这也反映出在市场大幅上扬,估值水平上升后,牛市心态支持下,短期内市场已经有一定的泡沫。短期内,受制于估值水平的提升,宏观紧缩政策的延续及新股发行节奏的加快,市场将延续振荡的走势。不过,从一个较长的时期来看,决定市场未来走势的基本因素:经济的持续增长及企业盈利水平的不断提升仍将持续,尤其全流通后,上市公司治理结构的改善,大小股东利益的趋同将不断提升企业的投资价值,因此,从长期来看,市场将维持持续上升的格局。

基于对市场的乐观判断,上半年华宝兴业多策略基金将资产重点配置在股票上,考虑到人民币升值和内需的持续增长,在行业的选择上重点配置了地产、金融和消费品等行业,在上半年也取得了较好的投资回报,但遗憾的是对有色、商业和机械等行业的配置不够,使的

净值的增长相对落后与其他基金。

就未来来看，基于对市场长期看好，短期有风险的判断，我们在策略倾向于相对稳健的投资策略，我们倾向于将主要资产配置在股票上，同时在股票的选择上将着重选择能够穿越经济周期，分享经济持续增长的优势企业，而对一些缺乏实际业绩支撑，以概念为主题投资采取谨慎的态度。具体而言，我们将对以下几类资产给予较多的关注：一是在人民币升值的大背景下，将不断被重估的资产类企业，包括地产、金融、商业网络和基础设施等；二是稀缺资源类企业，包括有色、煤炭、石油天然气及土地等；三是具有自主创新能力和品牌的优势企业，包括食品饮料及军工、机械等。

#### 第四章 托管人报告

中国建设银行股份有限公司根据《华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金合同》和《华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金托管协议》，托管华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金（以下简称多策略增长基金）。

本报告期，中国建设银行股份有限公司在多策略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多策略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。

由多策略增长基金管理人——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、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 财务会计报告

##### 1. 基金比较式资产负债表

金额单位：人民币元

| 资 产     | 截至 2006 年 6 月 30 日 | 截至 2005 年 12 月 31 日 |
|---------|--------------------|---------------------|
| 银行存款    | 200,839,913.59     | 127,533,156.69      |
| 清算备付金   | 7,408,290.62       | 1,588,589.60        |
| 交易保证金   | 1,715,094.80       | 735,788.27          |
| 应收证券清算款 | 0.00               | 17,044,474.01       |
| 应收股利    | 416,169.63         | 0.00                |
| 应收利息    | 62,204.75          | 7,185,572.54        |

|            |                  |                  |
|------------|------------------|------------------|
| 应收申购款      | 38,415.00        | 16,062.23        |
| 其他应收款      | 48,400.00        | 0.00             |
| 股票投资市值     | 1,151,144,762.11 | 2,242,415,719.95 |
| 其中：股票投资成本  | 947,437,000.34   | 2,244,378,228.66 |
| 债券投资市值     | 0.00             | 770,868,356.68   |
| 其中：债券投资成本  | 0.00             | 774,531,862.40   |
| 权证投资       | 1,272,600.00     | 0.00             |
| 其中：权证投资成本  | 0.00             | 0.00             |
| 买入返售证券     | 0.00             | 0.00             |
| 待摊费用       | 40,218.30        | 139,287.60       |
| 其他资产       | 0.00             | 0.00             |
| 资产合计       | 1,362,986,068.80 | 3,167,527,007.57 |
| 负债与持有人权益   |                  |                  |
| 应付证券清算款    | 0.00             | 20,460,934.65    |
| 应付赎回款      | 17,021,377.41    | 12,639,961.86    |
| 应付赎回费      | 39,742.11        | 47,160.33        |
| 应付管理人报酬    | 1,682,892.53     | 3,916,805.21     |
| 应付托管费      | 280,482.08       | 652,800.89       |
| 应付佣金       | 4,924,515.45     | 805,139.40       |
| 应付利息       | 0.00             | 0.00             |
| 应付收益       | 0.00             | 0.00             |
| 未交税金       | 0.00             | 0.00             |
| 其他应付款      | 260,413.90       | 257,851.60       |
| 卖出回购证券款    | 0.00             | 0.00             |
| 短期借款       | 0.00             | 0.00             |
| 预提费用       | 100,802.52       | 120,000.00       |
| 其他负债       | 0.00             | 0.00             |
| 负债合计       | 24,310,226.00    | 38,900,653.94    |
| 实收基金       | 1,047,108,249.61 | 3,294,822,361.79 |
| 未实现利得      | 15,327,328.88    | 607,983.82       |
| 未分配收益      | 276,240,264.31   | -166,803,991.98  |
| 持有人权益合计    | 1,338,675,842.80 | 3,128,626,353.63 |
| 负债及持有人权益合计 | 1,362,986,068.80 | 3,167,527,007.57 |

## 2. 基金比较式经营业绩及收益分配表

金额单位：人民币元

| 项目        | 本期数            | 2005 年 1 月 1 日至<br>2005 年 6 月 30 日止期间 |
|-----------|----------------|---------------------------------------|
| 一、已实现基金收入 | 604,458,155.11 | -100,841,871.06                       |
| 其中：股票差价收入 | 572,827,072.53 | -167,872,519.78                       |
| 债券差价收入    | -5,246,473.88  | 8,295,126.34                          |
| 权证差价收入    | 12,561,094.36  | 0.00                                  |

|              |                 |                 |
|--------------|-----------------|-----------------|
| 债券利息收入       | 3,399,487.58    | 10,619,292.15   |
| 存款利息收入       | 818,387.78      | 1,093,415.75    |
| 股利收入         | 16,613,743.92   | 45,671,971.29   |
| 买入返售证券收入     | 65,095.89       | 176,301.37      |
| 其他收入         | 3,419,746.93    | 1,174,541.82    |
| 减：基金费用       | 18,619,871.17   | 33,729,880.85   |
| 其中：基金管理人报酬   | 15,776,564.02   | 28,606,601.65   |
| 基金托管费        | 2,629,427.33    | 4,767,766.94    |
| 卖出回购证券支出     | 0.00            | 133,654.93      |
| 利息支出         | 0.00            | 0.00            |
| 其他费用         | 213,879.82      | 221,857.33      |
| 其中：上市年费      | 0.00            | 0.00            |
| 信息披露费        | 148,795.43      | 149,749.82      |
| 审计费用         | 51,076.39       | 54,547.97       |
| 二、已实现基金收益    | 585,838,283.94  | -134,571,751.91 |
| 加：未实现利得      | 210,606,376.20  | -141,623,275.02 |
| 三、基金经营业绩     | 796,444,660.14  | -276,195,026.93 |
| 本期基金净收益      | 585,838,283.94  | -134,571,751.91 |
| 加：期初基金净收益    | -166,803,991.98 | -27,098,520.39  |
| 加：本期损益平准金    | 15,135,081.64   | 11,619,986.44   |
| 可供分配基金净收益    | 434,169,373.60  | -150,050,285.86 |
| 减：本期已分配基金净收益 | 157,929,109.29  | 0.00            |
| 期末基金净收益      | 276,240,264.31  | -150,050,285.86 |

### 3. 基金比较式净值变动表

金额单位：人民币元

| 项目                 | 本期数               | 2005 年 1 月 1 日至<br>2005 年 6 月 30 日止期间 |
|--------------------|-------------------|---------------------------------------|
| 一、期初基金净值           | 3,128,626,353.63  | 4,125,875,963.63                      |
| 二、本期经营活动           |                   |                                       |
| 基金净收益              | 585,838,283.94    | -134,571,751.91                       |
| 未实现利得              | 210,606,376.20    | -141,623,275.02                       |
| 经营活动产生的基金净值变动数     | 796,444,660.14    | -276,195,026.93                       |
| 三、本期基金单位交易         |                   |                                       |
| 基金申购款              | 473,978,055.55    | 400,068,070.57                        |
| 基金赎回款              | 2,902,444,117.23  | 915,292,964.13                        |
| 基金单位交易产生的基金净值变动数   | -2,428,466,061.68 | -515,224,893.56                       |
| 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 | 157,929,109.29    | 0.00                                  |
| 五、期末基金净值           | 1,338,675,842.80  | 3,334,456,043.14                      |

## 4. 会计报表附注

(1) 本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致。

(2) 报告期内，本基金无重大会计差错。

(3) 应收利息

金额单位：人民币元

|           | 2006 年 6 月 30 日 |
|-----------|-----------------|
| 应收银行存款利息  | 58,807.75       |
| 应收清算备付金利息 | 3,333.70        |
| 应收权证保证金利息 | 63.30           |
| 合计        | 62,204.75       |

(4) 待摊费用

金额单位：人民币元

|          | 2006 年 6 月 30 日 |
|----------|-----------------|
| 上证报信息披露费 | 40,218.30       |
| 合计       | 40,218.30       |

(5) 应付佣金

金额单位：人民币元

|      | 2006 年 6 月 30 日 |
|------|-----------------|
| 长江证券 | 286,284.48      |
| 海通证券 | 724,597.96      |
| 联合证券 | 308,378.56      |
| 申银万国 | 805,661.44      |
| 国泰君安 | 492,547.19      |
| 中信建投 | 425,434.88      |
| 招商证券 | 820,686.49      |
| 银河证券 | 257,511.53      |
| 光大证券 | 612,075.45      |
| 国金证券 | 191,337.47      |
| 合计   | 4,924,515.45    |

(6) 其他应付款

金额单位：人民币元

|               | 2006 年 6 月 30 日 |
|---------------|-----------------|
| 券商            | 250,000.00      |
| 应付可转债税金       | 6,101.60        |
| 应付银行间结算服务费-债券 | 900.00          |
| 应付银行间交易手续费-债券 | 1,999.50        |
| 应付银行间交易手续费-回购 | 165.00          |
| 其他            | 1,247.80        |

|    |            |
|----|------------|
| 合计 | 260,413.90 |
|----|------------|

## (7) 预提费用

金额单位：人民币元

|           | 2006 年 6 月 30 日 |
|-----------|-----------------|
| 审计费       | 51,076.39       |
| 证券时报信息披露费 | 49,726.13       |
| 合计        | 100,802.52      |

## (8) 实收基金

金额单位：人民币元

|                  | 基金单位数(份)         | 基金面值(元)          |
|------------------|------------------|------------------|
| 2005 年 12 月 31 日 | 3,294,822,361.79 | 3,294,822,361.79 |
| 本期申购、转入          | 442,181,067.43   | 442,181,067.43   |
| 其中：红利转再投资        | 14,461,599.63    | 14,461,599.63    |
| 本期赎回、转出          | 2,689,895,179.61 | 2,689,895,179.61 |
| 2006 年 6 月 30 日  | 1,047,108,249.61 | 1,047,108,249.61 |

## (9) 未实现利得

金额单位：人民币元

|                  | 未实现估值增值        | 未实现利得平准金        | 未实现利得权证      | 合计             |
|------------------|----------------|-----------------|--------------|----------------|
| 2005 年 12 月 31 日 | -5,626,014.43  | 6,233,998.25    | -            | 607,983.82     |
| 本期净变动数           | 209,333,776.20 | -195,887,031.14 | 1,272,600.00 | 14,719,345.06  |
| 本期申购、转入基金份额      | -              | 39,001,871.80   | -            | 39,001,871.80  |
| 其中：分红转再投资        | -              | 1,981,669.98    | -            | 1,981,669.98   |
| 本期赎回、转出基金份额      | -              | 234,888,902.94  | -            | 234,888,902.94 |
| 2006 年 6 月 30 日  | 203,707,761.77 | -189,653,032.89 | 1,272,600.00 | 15,327,328.88  |

未实现估值增值按投资类别分项列示如下：

金额单位：人民币元

|      | 2006 年 6 月 30 日 |
|------|-----------------|
| 股票投资 | 203,707,761.77  |
| 债券投资 | -               |

## (10) 股票差价收入

金额单位：人民币元

|            | 2006 年 1 月 1 日<br>至 2006 年 6 月 30 日止期间 |
|------------|----------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 4,438,889,659.38                       |
| 减：应付佣金总额   | 3,595,028.06                           |
| 减：卖出股票成本总额 | 3,862,467,558.79                       |
| 股票差价收入     | 572,827,072.53                         |

本基金于本报告期获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价共计 3,868,210.85 元(2005 年 1 月 1 日至 2005 年 6 月 30 日：无)，已全额冲减股票投资成本。

**(11) 债券差价收入**

金额单位：人民币元

|             | 2006 年 1 月 1 日<br>至 2006 年 6 月 30 日止期间 |
|-------------|----------------------------------------|
| 卖出债券结算金额    | 1,151,260,503.48                       |
| 减：应收利息总额    | 20,429,235.89                          |
| 减：卖出债券成本总额  | 1,136,074,066.97                       |
| 减：银行间债券交易费用 | 3,674.50                               |
| 债券差价收入      | -5,246,473.88                          |

**(12) 其他收入**

金额单位：人民币元

|             | 2006 年 1 月 1 日<br>至 2006 年 6 月 30 日止期间 |
|-------------|----------------------------------------|
| 赎回基金补偿收入(a) | 3,419,746.93                           |
| 合计          | 3,419,746.93                           |

(a) 根据 2004 年 8 月 7 日《华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金调整赎回费中计入基金资产比例的临时公告》，本基金自 2004 年 8 月 10 日起，赎回费用中归入基金资产的比例调整至 25%，其余部分作为注册登记费。

**(13) 其他费用**

金额单位：人民币元

|           | 2006 年 1 月 1 日<br>至 2006 年 6 月 30 日止期间 |
|-----------|----------------------------------------|
| 银行费用      | 3,733.00                               |
| 信息披露费     | 148,795.43                             |
| 审计费用      | 51,076.39                              |
| 债券帐户维护费   | 9,000.00                               |
| 其他手续费     | 990.00                                 |
| 银行间回购交易费用 | 285.00                                 |
| 合计        | 213,879.82                             |

**(14) 收益分配**

基金管理人于 2006 年 5 月 11 日发布公告，向截至 2006 年 5 月 10 日止在本基金注册登记人华宝兴业基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金单位 1.20 元派发现金红利。该分红的发放日为 2006 年 5 月 11 日，共发放红利 157,929,109.29 元，其中以现金形式发放 141,118,926.06 元，以红利再投资形式发放 16,810,183.23 元。

**(15) 重大关联方关系及关联交易****1) 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<br>(“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<br>(“华宝信托”)                               | 基金管理人的股东     |
| 法国兴业资产管理有限公司<br>(Société Générale Asset Management SA) | 基金管理人的股东     |
| 上海宝钢集团公司<br>(“宝钢集团”)                                   | 基金管理人的股东的母公司 |

## 2) 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 × 1.5% / 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬 15,776,564.02 元。( 去年同期的管理人报酬为 28,606,601.65 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 × 0.25% / 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金托管费 2,629,427.33 元。( 去年同期的托管费为 4,767,766.94 元 )

### (c) 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，并按银行间同业利率计息。基金托管人于 2006 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 200,839,913.59 元，截至去年 6 月 30 日基金托管人保管的银行存款余额为 329,518,475.32 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 782,414.81 元，去年同期由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 1,067,913.53 元。

### (d) 与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易（含回购）

本基金在本会计期间与基金托管人中国建设银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下：

金额单位：人民币元

|            | 2006 年 1 月 1 日<br>至 2006 年 6 月 30 日止期间 | 2005 年 1 月 1 日<br>至 2005 年 6 月 30 日止期间 |
|------------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 买入债券结算金额   | 0.00                                   | 311,584,000                            |
| 卖出回购证券协议金额 | 0.00                                   | 495,400,000                            |
| 卖出回购证券利息支出 | 0.00                                   | 133,654.93                             |

### (e) 关联方持有的基金份额

金额单位：人民币元

|  | 2006 年 6 月 30 日 |           |               | 2005 年 6 月 30 日 |           |               |
|--|-----------------|-----------|---------------|-----------------|-----------|---------------|
|  | 基金份额<br>(份)     | 净值<br>(元) | 占基金总份<br>额的比例 | 基金份额<br>(份)     | 净值<br>(元) | 占基金总份<br>额的比例 |

|      |      |      |       |                |                |       |
|------|------|------|-------|----------------|----------------|-------|
| 宝钢集团 | 0.00 | 0.00 | 0.00% | 204,289,562.14 | 181,899,426.13 | 5.46% |
| 华宝信托 | 0.00 | 0.00 | 0.00% | 30,003,000.00  | 26,714,671.20  | 0.80% |
| 合计   | 0.00 | 0.00 | 0.00% | 234,292,562.14 | 208,614,097.33 | 6.26% |

## (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。

## (16) 流通受限制不能自由转让的基金资产

流通受限制不能自由转让的股票：

根据中国证监会的政策规定和证券交易所的交易规则,基金认购或配售的新股在一定时期以内不能上市自由流通。本基金截至 2006 年 6 月 30 日止流通受限制的股票情况如下：

## 1) 新股发行

金额单位：人民币元

| 股票名称 | 成功申购日期    | 上市日期     | 可流通日期    | 申购价格 | 期末估价 | 成功申购股数(股)  | 成本         | 估值         |
|------|-----------|----------|----------|------|------|------------|------------|------------|
| 中国银行 | 2006-6-28 | 2006-7-5 | 2006-7-5 | 3.08 | 3.08 | 194,000.00 | 597,520.00 | 597,520.00 |
| 合 计  |           |          |          |      |      | 194,000.00 | 597,520.00 | 597,520.00 |

## 2) 股权分置改革

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期      | 期末估值单价 | 可流通日期     | 复牌开盘单价 | 股数(股)      | 期末成本总额        | 期末估值总额         |
|--------|------|-----------|--------|-----------|--------|------------|---------------|----------------|
| 600035 | 楚天高速 | 2006-6-23 | 4.92   | 2006-7-11 | 5.38   | 2,124,800  | 7,606,895.60  | 10,454,016.00  |
| 600201 | 金宇集团 | 2006-6-8  | 6.46   | 2006-7-12 | 4.52   | 1,259,280  | 8,726,681.83  | 8,134,948.80   |
| 600371 | 华冠科技 | 2006-6-13 | 8.05   | -         | -      | 1,195,870  | 7,909,228.65  | 9,626,753.50   |
| 600383 | 金地集团 | 2006-6-12 | 8.57   | 2006-7-11 | 9.43   | 12,952,165 | 72,936,967.97 | 111,000,054.05 |
| 600662 | 强生控股 | 2006-6-16 | 5.07   | -         | -      | 1,999,905  | 10,218,206.37 | 10,139,518.35  |
| 600755 | 厦门国贸 | 2006-6-22 | 7.94   | 2006-7-10 | 5.88   | 1,849,234  | 14,075,431.16 | 14,682,917.96  |
| 600883 | 博闻科技 | 2006-6-15 | 7.58   | 2006-7-7  | 5.98   | 4,894,598  | 34,672,698.43 | 37,101,052.84  |
| 600970 | 中材国际 | 2006-6-15 | 26.84  | 2006-7-6  | 23.80  | 480,366    | 8,925,107.56  | 12,893,023.44  |
| 000657 | 中钨高新 | 2006-6-9  | 13.33  | 2006-7-6  | 14.66  | 655,208    | 9,710,298.47  | 8,733,922.64   |
| 000895 | 双汇发展 | 2006-5-31 | 31.17  | -         | -      | 1,177,000  | 19,917,923.49 | 36,687,090.00  |

说明：“期末估价”是以 2006 年 6 月 30 日的股票收盘价估值。

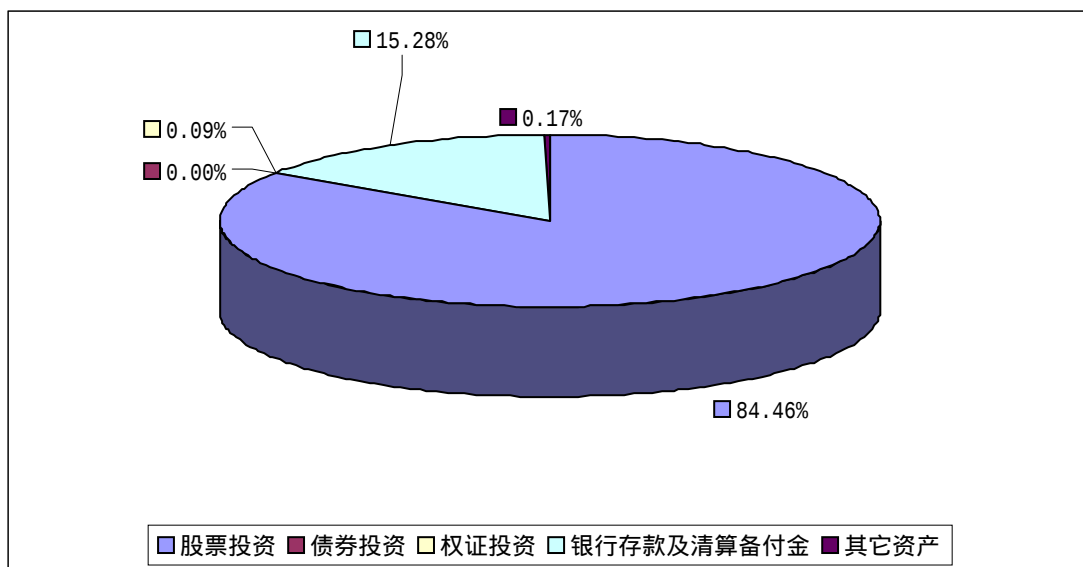
## 第六章 投资组合报告

## 1. 基金资产组合

截至 2006 年 6 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 | 1,151,144,762.11 | 84.46%   |
| 债券投资 | 0.00             | 0.00%    |
| 权证投资 | 1,272,600.00     | 0.09%    |

|            |                  |         |
|------------|------------------|---------|
| 银行存款及清算备付金 | 208,248,204.21   | 15.28%  |
| 其它资产       | 2,320,502.48     | 0.17%   |
| 合计         | 1,362,986,068.80 | 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       | 0.00           | 0.00%  |
| 2  | 采掘业            | 69,994,066.34  | 5.23%  |
| 3  | 制造业            | 532,284,687.27 | 39.76% |
|    | 其中：食品、饮料       | 190,496,753.05 | 14.23% |
|    | 纺织、服装、皮毛       | 00.00          | 0.00%  |
|    | 木材、家具          | 6,786,365.40   | 0.51%  |
|    | 造纸、印刷          | 9,484,295.02   | 0.71%  |
|    | 石油、化学、塑胶、塑料    | 13,418,006.00  | 1.00%  |
|    | 电子             | 20,536,266.45  | 1.53%  |
|    | 金属、非金属         | 82,591,922.09  | 6.17%  |
|    | 机械、设备、仪表       | 173,638,603.56 | 12.97% |
|    | 医药、生物制品        | 35,332,475.70  | 2.64%  |
|    | 其他制造业          | 0.00           | 0.00%  |
| 4  | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 0.00           | 0.00%  |
| 5  | 建筑业            | 16,283,773.44  | 1.22%  |
| 6  | 交通运输、仓储业       | 104,974,541.61 | 7.84%  |
| 7  | 信息技术业          | 13,371,942.60  | 1.00%  |
| 8  | 批发和零售贸易业       | 109,509,118.66 | 8.18%  |
| 9  | 金融、保险业         | 84,556,661.95  | 6.32%  |
| 10 | 房地产业           | 112,809,139.73 | 8.43%  |
| 11 | 社会服务业          | 10,139,518.35  | 0.76%  |

|    |         |                  |        |
|----|---------|------------------|--------|
| 12 | 传播与文化产业 | 36,092,493.46    | 2.70%  |
| 13 | 综合类     | 61,128,818.70    | 4.57%  |
| 14 | 合计      | 1,151,144,762.11 | 85.99% |

### 3. 基金投资股票明细

| 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  | 600383 | 金地集团  | 12,952,165.00 | 111,000,054.05 | 8.2918%   |
| 2  | 600887 | G 伊 利 | 2,570,897.00  | 58,590,742.63  | 4.3768%   |
| 3  | 000858 | G 五粮液 | 3,572,398.00  | 51,942,666.92  | 3.8802%   |
| 4  | 600009 | G 沪机场 | 3,548,421.00  | 51,132,746.61  | 3.8197%   |
| 5  | 600030 | G 中 信 | 2,529,940.00  | 40,074,249.60  | 2.9936%   |
| 6  | 600883 | G 博 闻 | 4,894,598.00  | 37,101,052.84  | 2.7715%   |
| 7  | 600316 | 洪都航空  | 1,063,482.00  | 36,934,729.86  | 2.7590%   |
| 8  | 000895 | 双汇发展  | 1,177,000.00  | 36,687,090.00  | 2.7406%   |
| 9  | 600348 | G 国 阳 | 2,672,098.00  | 35,619,066.34  | 2.6608%   |
| 10 | 600028 | 中国石化  | 5,500,000.00  | 34,375,000.00  | 2.5678%   |
| 11 | 000729 | G 燕 啤 | 3,500,000.00  | 29,925,000.00  | 2.2354%   |
| 12 | 600456 | G 宝 钛 | 584,158.00    | 27,858,495.02  | 2.0810%   |
| 13 | 600717 | G 天津港 | 3,280,000.00  | 27,552,000.00  | 2.0582%   |
| 14 | 600739 | G 成 大 | 2,165,154.00  | 25,722,029.52  | 1.9215%   |
| 15 | 600888 | G 众 和 | 904,397.00    | 25,169,368.51  | 1.8802%   |
| 16 | 600037 | G 歌 华 | 1,516,369.00  | 22,351,279.06  | 1.6697%   |
| 17 | 600036 | G 招 行 | 2,865,339.00  | 22,091,763.69  | 1.6503%   |
| 18 | 600320 | G 振 华 | 1,099,989.00  | 21,713,782.86  | 1.6220%   |
| 19 | 600016 | G 民 生 | 4,836,998.00  | 21,137,681.26  | 1.5790%   |
| 20 | 000061 | G 农产品 | 2,200,000.00  | 20,988,000.00  | 1.5678%   |
| 21 | 000537 | G 广 宇 | 4,797,137.00  | 18,804,777.04  | 1.4047%   |
| 22 | 002031 | 巨轮股份  | 2,299,895.00  | 17,755,189.40  | 1.3263%   |
| 23 | 000768 | G 西 飞 | 1,995,131.00  | 16,938,662.19  | 1.2653%   |
| 24 | 600563 | G 法 拉 | 1,710,000.00  | 16,911,900.00  | 1.2633%   |
| 25 | 000777 | G 中 核 | 1,848,311.00  | 16,154,238.14  | 1.2067%   |
| 26 | 600058 | G 五 矿 | 1,822,650.00  | 15,893,508.00  | 1.1873%   |
| 27 | 000900 | G 现投股 | 1,759,531.00  | 15,835,779.00  | 1.1829%   |
| 28 | 600104 | G 上 汽 | 2,656,089.00  | 15,564,681.54  | 1.1627%   |
| 29 | 600755 | G 厦国贸 | 1,849,234.00  | 14,682,917.96  | 1.0968%   |
| 30 | 600631 | G 百 联 | 1,750,000.00  | 14,052,500.00  | 1.0497%   |
| 31 | 600880 | G 博 瑞 | 919,760.00    | 13,741,214.40  | 1.0265%   |
| 32 | 600122 | 宏图高科  | 2,149,830.00  | 13,371,942.60  | 0.9989%   |
| 33 | 600970 | G 中 材 | 480,366.00    | 12,893,023.44  | 0.9631%   |
| 34 | 600196 | G 复 星 | 1,900,000.00  | 12,616,000.00  | 0.9424%   |

|    |        |       |              |               |         |
|----|--------|-------|--------------|---------------|---------|
| 35 | 600031 | G 三 一 | 799,967.00   | 11,511,525.13 | 0.8599% |
| 36 | 002037 | 久联发展  | 1,400,000.00 | 10,934,000.00 | 0.8168% |
| 37 | 600035 | 楚天高速  | 2,124,800.00 | 10,454,016.00 | 0.7809% |
| 38 | 600662 | 强生控股  | 1,999,905.00 | 10,139,518.35 | 0.7574% |
| 39 | 600686 | G 金 龙 | 834,955.00   | 9,877,517.65  | 0.7379% |
| 40 | 600500 | G 中 化 | 1,734,714.00 | 9,818,481.24  | 0.7334% |
| 41 | 000039 | G 中 集 | 600,000.00   | 9,660,000.00  | 0.7216% |
| 42 | 600371 | 华冠科技  | 1,195,870.00 | 9,626,753.50  | 0.7191% |
| 43 | 600163 | G 南 纸 | 2,619,971.00 | 9,484,295.02  | 0.7085% |
| 44 | 600085 | G 同仁堂 | 556,600.00   | 9,111,542.00  | 0.6806% |
| 45 | 000657 | 中钨高新  | 655,208.00   | 8,733,922.64  | 0.6524% |
| 46 | 600201 | 金宇集团  | 1,259,280.00 | 8,134,948.80  | 0.6077% |
| 47 | 600089 | G 特 变 | 600,000.00   | 7,734,000.00  | 0.5777% |
| 48 | 600312 | G 平 高 | 593,137.00   | 7,117,644.00  | 0.5317% |
| 49 | 600337 | G 美 克 | 780,042.00   | 6,786,365.40  | 0.5069% |
| 50 | 600628 | G 新世界 | 600,000.00   | 5,274,000.00  | 0.3940% |
| 51 | 000043 | G 深南光 | 660,302.00   | 5,222,988.82  | 0.3902% |
| 52 | 000617 | 石油济柴  | 249,666.00   | 5,178,072.84  | 0.3868% |
| 53 | 600062 | G 双 鹤 | 700,654.00   | 4,617,309.86  | 0.3449% |
| 54 | 600549 | G 厦 钨 | 300,000.00   | 4,593,000.00  | 0.3431% |
| 55 | 600459 | G 贵 研 | 370,653.00   | 4,358,879.28  | 0.3256% |
| 56 | 600343 | G 航动力 | 499,905.00   | 3,894,259.95  | 0.2909% |
| 57 | 600132 | 重庆啤酒  | 150,000.00   | 3,724,500.00  | 0.2782% |
| 58 | 002025 | 航天电器  | 141,965.00   | 3,624,366.45  | 0.2707% |
| 59 | 600284 | G 浦 建 | 685,000.00   | 3,390,750.00  | 0.2533% |
| 60 | 600655 | G 豫 园 | 299,969.00   | 3,077,681.94  | 0.2299% |
| 61 | 000819 | 岳阳兴长  | 249,900.00   | 2,484,006.00  | 0.1856% |
| 62 | 000401 | G 冀 东 | 577,671.00   | 2,218,256.64  | 0.1657% |
| 63 | 600879 | G 火 箭 | 150,000.00   | 2,023,500.00  | 0.1512% |
| 64 | 000046 | G 泛 海 | 233,732.00   | 1,809,085.68  | 0.1351% |
| 65 | 600262 | G 北 重 | 120,000.00   | 1,240,800.00  | 0.0927% |
| 66 | 600750 | G 江 中 | 83,432.00    | 852,675.04    | 0.0637% |
| 67 | 600000 | G 浦 发 | 66,140.00    | 655,447.40    | 0.0490% |
| 68 | 601988 | 中国银行  | 194,000.00   | 597,520.00    | 0.0446% |

#### 4. 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<br>买入金额(元) | 本期累计买入占<br>期初基金资产净值比例 |
|----|------|------|-----------------|-----------------------|
|----|------|------|-----------------|-----------------------|

|    |        |        |                |       |
|----|--------|--------|----------------|-------|
| 1  | 600900 | G 长 电  | 108,271,575.95 | 3.46% |
| 2  | 000069 | G 华侨城  | 74,327,334.97  | 2.38% |
| 3  | 000002 | G 万科 A | 71,778,078.70  | 2.29% |
| 4  | 000858 | G 五粮液  | 68,226,922.39  | 2.18% |
| 5  | 600030 | G 中 信  | 67,098,411.62  | 2.14% |
| 6  | 600016 | G 民 生  | 66,538,143.78  | 2.13% |
| 7  | 600009 | G 沪机场  | 66,268,907.41  | 2.12% |
| 8  | 000768 | G 西 飞  | 61,777,080.82  | 1.97% |
| 9  | 600688 | 上海石化   | 43,185,172.15  | 1.38% |
| 10 | 000537 | G 广 宇  | 39,356,641.96  | 1.26% |
| 11 | 600028 | 中国石化   | 39,347,430.10  | 1.26% |
| 12 | 000839 | G 国 安  | 39,144,059.42  | 1.25% |
| 13 | 000911 | G 南 糖  | 37,305,266.78  | 1.19% |
| 14 | 600883 | G 博 闻  | 35,203,988.72  | 1.13% |
| 15 | 600002 | 齐鲁石化   | 35,141,890.01  | 1.12% |
| 16 | 000866 | 扬子退市   | 34,392,648.22  | 1.10% |
| 17 | 600519 | G 茅 台  | 33,326,396.91  | 1.07% |
| 18 | 000895 | 双汇发展   | 32,701,818.50  | 1.05% |
| 19 | 000063 | G 中 兴  | 31,189,269.07  | 1.00% |
| 20 | 600036 | G 招 行  | 30,535,613.09  | 0.98% |

## (2) 累计卖出重大变动

| 序号 | 股票代码   | 股票名称   | 本期累计<br>卖出金额(元) | 本期累计卖出<br>期初占基金资产净值比例 |
|----|--------|--------|-----------------|-----------------------|
| 1  | 600900 | G 长 电  | 198,701,128.20  | 6.35%                 |
| 2  | 600036 | G 招 行  | 163,542,956.08  | 5.23%                 |
| 3  | 600028 | 中国石化   | 156,689,182.57  | 5.01%                 |
| 4  | 000002 | G 万科 A | 128,320,493.65  | 4.10%                 |
| 5  | 000651 | G 格 力  | 123,680,580.37  | 3.95%                 |
| 6  | 600519 | G 茅 台  | 120,194,260.61  | 3.84%                 |
| 7  | 600033 | 福建高速   | 95,915,777.48   | 3.07%                 |
| 8  | 600348 | G 国 阳  | 84,181,016.16   | 2.69%                 |
| 9  | 000069 | G 华侨城  | 75,779,654.84   | 2.42%                 |
| 10 | 000983 | G 西 煤  | 73,460,999.53   | 2.35%                 |
| 11 | 600497 | G 驰 宏  | 68,892,578.83   | 2.20%                 |
| 12 | 600123 | G 兰 花  | 66,963,216.65   | 2.14%                 |
| 13 | 600549 | G 厦 钨  | 63,733,607.17   | 2.04%                 |
| 14 | 600308 | G 华 泰  | 62,678,030.33   | 2.00%                 |
| 15 | 000630 | G 铜 都  | 61,646,687.94   | 1.97%                 |
| 16 | 600276 | G 恒 瑞  | 61,392,884.56   | 1.96%                 |
| 17 | 600000 | G 浦 发  | 60,198,099.06   | 1.92%                 |
| 18 | 600271 | G 航 信  | 59,374,531.23   | 1.90%                 |
| 19 | 600016 | G 民 生  | 59,326,433.58   | 1.90%                 |

|    |        |       |               |       |
|----|--------|-------|---------------|-------|
| 20 | 600887 | G 伊 利 | 55,840,911.61 | 1.78% |
|----|--------|-------|---------------|-------|

## (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(元)    | 本期卖出股票收入总额(元)    |
|------------------|------------------|
| 2,569,394,541.32 | 4,438,889,659.38 |

## 5. 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. 基金债券投资前 5 名明细

本基金本报告期末无债券余额，特此报告。

## 7. 基金资产支持证券投资明细

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 1,715,094.80 元、应收股利 416,169.63 元、应收利息 62,204.75 元、应收申购款 38,415.00 元、其他应收款 48,400.00 元、待摊费用 40,218.30 元。

(4) 本基金未持有在转股期内的可转换债券。

(5) 本基金持有的权证均为股权分置改革被动持有，至今尚未发生主动投资权证的交易。本基金在本报告期内持有的权证明细如下：

| 权证代码   | 权证名称    | 数量(份)      | 成本(元) | 期末市值(元) |
|--------|---------|------------|-------|---------|
| 580007 | 长电 CWB1 | 375,000.00 | 0.00  | 0.00    |
| 030002 | 五粮 YGC1 | 908,700.00 | 0.00  | 0.00    |
| 038004 | 五粮 YGP1 | 955,300.00 | 0.00  | 0.00    |

|        |         |              |      |              |
|--------|---------|--------------|------|--------------|
| 038006 | 中集 ZYP1 | 1,050,000.00 | 0.00 | 1,272,600.00 |
| 总计     |         | 3,289,000.00 | 0.00 | 1,272,600.00 |

## 第七章 基金份额持有人户数、持有人结构

本基金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 | 持有人户均持有基金份额（份） | 机构投资者持有份额（份）   | 个人投资人持有份额（份）   | 机构投资者持有份额比例 | 个人投资人持有份额比例 |
|-------------|--------|----------------|----------------|----------------|-------------|-------------|
| 华宝兴业多策略增长基金 | 26453  | 39,583.72      | 299,382,624.35 | 747,725,625.26 | 28.59%      | 71.41%      |

## 第八章 基金份额变动情况

本基金在基金合同生效日的基金份额总额为 5,233,338,344.60 份。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        | 期初总份额            | 期末总份额            | 期间总申购份额        | 期间总赎回份额          |
|-------------|------------------|------------------|----------------|------------------|
| 华宝兴业多策略增长基金 | 3,294,822,361.79 | 1,047,108,249.61 | 442,181,067.43 | 2,689,895,179.61 |

## 第九章 重大事件揭示

1. 报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

2. 2006 年 4 月，因工作需要，经基金管理人公司董事会研究决定，聘任余荣权先生担任本基金的基金经理，童国林先生不再担任本基金的基金经理。将该任免同时报中国证监会上海证管局备案。

基金管理人已于 2006 年 4 月 28 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。

3. 本系列基金在本报告期内进行了一次收益分配：

基金管理人按照 2006 年 5 月 10 日基金权益登记情况，将基金可分配收益向本基金份额持有人按每 10 份基金单位派发红利 1.20 元。

基金管理人已于 2006 年 5 月 11 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此收益分配事项公告。

4. 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 5 月 15 日到 2006 年 6 月 14 日期间开展基金优惠申购费率活动，涉及基金

包括华宝兴业宝康系列基金、本基金、华宝兴业动力组合基金。

基金管理人已于 2006 年 5 月 10 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布了此事项公告。

5. 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。

#### 6. 基金租用交易席位情况

报告期内,本基金共租用长江证券、海通证券、国元证券、联合证券、申银万国、国泰君安、中信建投、东吴证券、招商证券、国金证券、银河证券、光大证券等12个交易专用席位。银河证券租用的席位系本报告期内新增交易席位,各券商专用席位交易和佣金情况如下:

(1) 本基金 2006 年上半年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  | 长江证券 | 461,654,421.26   | 6.67%   | 283,410.44   | 5.15%   |
| 2  | 银河证券 | 314,834,684.68   | 4.55%   | 257,511.53   | 4.68%   |
| 3  | 光大证券 | 747,418,272.38   | 10.79%  | 612,075.45   | 11.13%  |
| 4  | 国金证券 | 441,211,178.84   | 6.37%   | 360,097.67   | 6.55%   |
| 5  | 海通证券 | 885,335,783.64   | 12.78%  | 724,597.96   | 13.17%  |
| 6  | 联合证券 | 607,401,923.57   | 8.77%   | 497,491.81   | 9.04%   |
| 7  | 申银万国 | 1,029,586,765.57 | 14.86%  | 805,661.44   | 14.65%  |
| 8  | 国泰君安 | 870,939,663.50   | 12.57%  | 713,518.30   | 12.97%  |
| 9  | 中信建投 | 519,264,505.09   | 7.50%   | 425,434.88   | 7.74%   |
| 10 | 招商证券 | 1,048,785,250.33 | 15.14%  | 820,686.49   | 14.92%  |
| 11 | 国元证券 | 0.00             | 0.00%   | 0.00         | 0.00%   |
| 12 | 东吴证券 | 0.00             | 0.00%   | 0.00         | 0.00%   |
| 合计 |      | 6,926,432,448.86 | 100.00% | 5,500,485.97 | 100.00% |

(2) 本基金 2006 年上半年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  | 长江证券 | 0.00           | 0.00%  | 0.00     | 0.00%  |
| 2  | 银河证券 | 65,031,012.81  | 9.03%  | 0.00     | 0.00%  |
| 3  | 光大证券 | 101,910,323.67 | 14.14% | 0.00     | 0.00%  |
| 4  | 国金证券 | 166,411,339.02 | 23.09% | 0.00     | 0.00%  |
| 5  | 海通证券 | 132,045,033.16 | 18.33% | 0.00     | 0.00%  |
| 6  | 联合证券 | 55,292,982.42  | 7.67%  | 0.00     | 0.00%  |
| 7  | 申银万国 | 100,507,705.81 | 13.95% | 0.00     | 0.00%  |

|    |      |                |         |      |       |
|----|------|----------------|---------|------|-------|
| 8  | 国泰君安 | 63,989,599.10  | 8.88%   | 0.00 | 0.00% |
| 9  | 中信建投 | 35,378,429.15  | 4.91%   | 0.00 | 0.00% |
| 10 | 招商证券 | 0.00           | 0.00%   | 0.00 | 0.00% |
| 11 | 国元证券 | 0.00           | 0.00%   | 0.00 | 0.00% |
| 12 | 东吴证券 | 0.00           | 0.00%   | 0.00 | 0.00% |
| 合计 |      | 720,566,425.14 | 100.00% | 0.00 | 0.00% |

## 第十章 备查文件目录

以下文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

- 1、证监会批准设立基金的文件
- 2、管理人业务批准文件、营业执照、公司章程
- 3、华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金合同
- 4、华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金招募说明书
- 5、华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金托管协议
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各种公告

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司

2006 年 8 月 24 日