

# 华宝兴业转型升级灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

## (更新)摘要 2016 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】

本基金经中国证券监督管理委员会 2015 年 10 月 9 日证监许可【2015】2249 号文注册，进行募集。

基金管理人保证《华宝兴业转型升级灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等其他风险。本基金是一只主动投资的混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》等信息披露文件，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

本招募说明书摘要所载内容截止日为 2016 年 6 月 15 日，有关财务数据和净值表现截

止日为 2016 年 3 月 31 日，数据未经审计。

## 一、《基金合同》生效日期

本基金自 2015 年 11 月 16 日到 2015 年 12 月 11 日向个人投资者和机构投资者同时发售，《基金合同》于 2015 年 12 月 15 日生效。

## 二、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：华宝兴业基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

法定代表人：郑安国

总经理：HUANG Xiaoyi Helen（黄小薏）

成立日期：2003 年 3 月 7 日

注册资本：1.5 亿元人民币

电话：021-38505888

联系人：章希

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）基金管理人主要人员情况

#### 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、董事长，华宝投资有限公司董事、总经理。现任华宝兴业基金管理有限公司董事长，中国太平洋保险(集团)股份有限公司董事。

HUANG Xiaoyi Helen（黄小薏）女士，董事，硕士。曾任加拿大 TD Securities 公司金融分析师，Acthop 投资公司财务总监。2003 年 5 月加入华宝兴业基金管理有限公司，曾任公司营运总监、董事会秘书、副总经理，现任公司总经理。

Lionel PAQUIN 先生，董事，硕士。曾在法国财政部、法国兴业银行、领先资产管理有限公司从事监察、风险管理和专户平台等业务，现任领先资产管理有限公司总裁。

Alexandre Werno 先生，董事，硕士。曾在法兴集团从事内审监察及国际业务战略风险管理工 作；曾任法国兴业银行全球市场执行董事、中国业务发展负责人。2013 年 5 月加入华宝兴业基金管理公司任总经理高级顾问，现任公司常务副总经理。

胡光先生，独立董事，硕士。曾任美国俄亥俄州舒士克曼律师事务所律师、飞利浦电子中国集团法律顾问、上海市邦信阳律师事务所合伙人。现任上海胡光律师事务所主任、首席合伙人。

尉安宁先生，独立董事，博士。曾任宁夏广播电视大学讲师，中国社会科学院经济研究所助理研究员，世界银行农业经济学家，荷兰合作银行东北亚区食品农业研究主管，新希望集团常务副总裁，比利时富通银行中国区 CEO 兼上海分行行长，山东亚太中慧集团董事长。现任上海谷旺投资管理有限公司董事长。

陈志宏先生，独立董事，硕士。曾任毕马威会计师事务所合伙人、普华永道会计师事务所合伙人，苏黎世金融服务集团中国区董事长。现任华彬国际投资（集团）有限公司高级顾问。

## 2、监事会成员

Anne MARION-BOUCHACOURT 女士，监事，硕士。曾任普华永道总监，杰米尼咨询金融机构业务副总裁，索尔文国际副总裁，法兴集团人力资源高级执行副总裁兼执行委员会委员。现任法兴集团中国区负责人，集团管理委员会委员。

欧江洪先生，监事，本科。曾任宝钢集团财务部主办、宝钢集团成本管理处主管、宝钢集团办公室（董事会办公室）主管/高级秘书、宝钢集团办公厅秘书室主任。现任华宝投资有限公司总经理助理。

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

郑安国先生，董事长，简历同上。

HUANG Xiaoyi Helen（黄小薏）女士，总经理，简历同上。

Alexandre Werno 先生，常务副总经理，简历同上。

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、华宝信托投资责任有限公司总裁助理兼董事会秘书，华宝证券经纪有限公司董事、副总经理。2007 年 8 月加入华宝兴业基金管理有限公司，曾任华宝兴业行业精选混合型证券投资基金基金经理。现任华宝兴业基金管理有限公司副总经理兼投资总监。

向辉先生，副总经理，硕士。曾在武汉长江金融审计事务所任副所长、在长盛基金管

理有限公司市场部任职。2002年加入华宝兴业基金公司参与公司的筹建工作，先后担任公司清算登记部总经理、营运副总监、营运总监，现任公司副总经理。

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

区伟良先生，2010年4月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后担任分析师、基金经理助理的职务。2015年4月起担任华宝兴业生态中国混合型证券投资基金基金经理，2015年12月起任华宝兴业转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

#### 5、权益投资决策委员会成员

任志强先生，副总经理、投资总监。

刘自强先生，投资副总监、华宝兴业动力组合混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业高端制造股票型证券投资基金基金经理、华宝兴业国策导向混合型证券投资基金基金经理。

闫旭女士，助理投资总监、国内投资部总经理、华宝兴业行业精选混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

范红兵先生，助理投资总监、华宝兴业医药生物优选混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业行业精选混合型证券投资基金基金经理。

胡戈游先生，助理投资总监、华宝兴业宝康消费品证券投资基金基金经理、华宝兴业品质生活股票型证券投资基金基金经理、华宝兴业核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

曾豪先生，研究部总经理。

#### 6、上述人员之间不存在近亲属关系。

##### （三）基金管理人职责

基金管理人应严格依法履行下列职责：

- 1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理本基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、按照规定召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、中国证监会规定的其他职责。

#### （四）基金管理人承诺

1、基金管理人将遵守《基金法》、《中华人民共和国证券法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行为的发生。

2、基金管理人不得从事下列行为：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）侵占、挪用基金财产；
- （6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （7）玩忽职守，不按照规定履行职责；
- （8）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金经理承诺

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

#### （五）基金管理人内部控制制度

1、风险管理体系

本基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规性风险、信誉风险和事件风险（如灾难）。

针对上述各种风险，基金管理人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）监察稽核及风险管理制度

监察稽核部和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。

监察稽核部和风险管理部负责调查评价公司内控制度的健全性、合理性；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；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；进行日常风险监控工作；协助评价基金财产风险状

况；负责包括基金经理离任审查在内的各项内部审计事务等。

### 3、基金管理人关于内部控制制度的声明书

- (1) 基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- (2) 基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人发展不断完善内部控制制度。

## 三、基金托管人

### (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：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

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：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2015 年末，本集团资产总额 18.35 万亿元，较上年增长 9.59%；客户贷款和垫款总额 10.49 万亿元，增长 10.67%；客户存款总额 13.67 万亿元，增长 5.96%。净利润 2,289 亿元，增长 0.28%；营业收入 6,052 亿元，增长 6.09%，其中，利息净收入增长 4.65%，手续费及佣金净收入增长 4.62%。平均资产回报率 1.30%，加权平均净资产收益率 17.27%，成本收入比 26.98%，资本充足率 15.39%，主要财务指标领先同业。

物理与电子渠道协同发展。营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点数量达 1.45 万个，综合营销团队 2.15 万个，综合柜员占比达到 88%。启动深圳等 8 家分行物理渠道全面转型创新试点，智慧网点、旗舰型、综合型和轻型网点建设有序推进。电子银行主渠道作用进一步凸显，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达 95.58%，较上年提升 7.55 个百分点；同时推广账号支付、手机支付、跨行付、龙卡云支付、快捷付等五种在线支付方式，成功实现绝大多数主要快捷支付业务的全行集中处理。



转型业务快速增长。信用卡累计发卡量 8,074 万张，消费交易额 2.22 万亿元，多项核心指标继续保持同业领先。金融资产 1,000 万以上的私人银行客户数量增长 23.08%，客户金融资产总量增长 32.94%。非金融企业债务融资工具累计承销 5,316 亿元，承销额市场领先。资产托管业务规模 7.17 万亿元，增长 67.36%；托管证券投资基金数量和新增只数均为市场第一。人民币国际清算网络建设再获突破，继伦敦之后，再获任瑞士、智利人民币清算行资格；上海自贸区、新疆霍尔果斯特殊经济区主要业务指标居同业首位。

2015 年，本集团先后获得国内外各类荣誉总计 122 项，并独家荣获美国《环球金融》杂志“中国最佳银行”、香港《财资》杂志“中国最佳银行”及香港《企业财资》杂志“中国最佳银行”等大奖。本集团在英国《银行家》杂志 2015 年“世界银行品牌 1000 强”中，以一级资本总额位列全球第二；在美国《福布斯》杂志 2015 年度全球企业 2000 强中位列第二。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等 10 个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工 220 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

赵观甫，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客

户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，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、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2016 年一季度末，中国建设银行已托管 584 只证券投资基金。中国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。中国建设银行自 2009 年至今连续六年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

## 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。资产托管业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

资产托管业务部具备系统、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

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等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，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，对指令要素等内容进行核查。
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和投资独立性等方面进行评价，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，电话或书面要求基金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）直销柜台

名称：华宝兴业基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

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、50988055

网址：[www.fsfund.com](http://www.fsfund.com)

##### （2）直销 e 网金

投资者可以通过华宝兴业基金管理有限公司网上交易直销 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华宝兴业基金管理有限公司网站公告。网上交易网址：[www.fsfund.com](http://www.fsfund.com)。

#### 2. 其他销售机构

##### （1）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：王洪章

客户服务电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

(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：田国立

客户服务电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(3) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

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](http://www.bankcomm.com)

(4) 平安银行股份有限公司

地址：深圳市深南东路 5047 号

法定代表人：孙建一

联系人：张莉

联系电话：021-38637673

传真电话：021-50979507

客户服务电话：95511-3

公司网址：[bank.pingan.com](http://bank.pingan.com)

(5) 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：李建红

联系人：邓炯鹏

联系电话：0755-83198888

公司网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

客户服务电话：95555

(6) 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

(7) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：中国·上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

联系人：高天、姚磊

电话：021-61618888

传真：021-63604196

客户服务热线：95528

公司网址：www.spdb.com.cn

(8) 中信银行股份有限公司

法定代表人：常振明

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

24小时客户服务热线：95558

网址：bank.ecitic.com

(9) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：杨德红

客服电话：95521

网址：www.gtja.com

(10) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路1508号

办公地址：上海市静安区新闸路1508号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨、李芳芳

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客户服务热线：95525、4008888788、10108998

公司网址：www.ebscn.com

(11) 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

（12）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

法定代表人：陈有安

客户服务电话：400-8888-888

电话：010-66568292

联系人：邓颜

公司网址：www.chinastock.com.cn

（13）中信建投证券股份有限公司

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：王常青

电话：400-8888-108(免长途费)

联系人：权唐

公司网址：www.csc108.com

（14）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：崔少华

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：奚博宇

客户服务热线：95579 或 4008-888-999

公司客服网址：www.95579.com

（15）东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号东吴证券大厦

法定代表人：范力

联系人：方晓丹

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

客服电话：4008-601555

网址：<http://www.dwzq.com.cn>

(16) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层（邮编：200031）

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客服电话：95523 或 4008895523

电话委托：021-962505

国际互联网网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

联系人：黄莹

(17) 平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层；

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层；

法定代表人：谢永林

联系人：周一涵

全国免费业务咨询电话：95511-8

开放式基金业务传真：021-38637436

公司网址：<http://www.stock.pingan.com>

(18) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期北座）

法定代表人：王东明

电话：010-60838888

传真：010-60833739

联系人：顾凌

客户服务电话：95548

公司网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(19) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：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

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：杨宝林

基金业务联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户咨询电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

（20）华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 楼

法定代表人：陈林

客服热线：400-820-9898，021-38929908

总部总机电话：021-68777222

传真：021-68777822

公司网站：<http://www.cnhbstock.com>

（21）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：0755-83515567

客户服务热线：0755-33680000、400 6666 888

公司网址：[www.cgws.com](http://www.cgws.com)

（22）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

法定代表人：王春峰

联系人：蔡霆胡天彤

电话：022-28451991022-28451709

传真：022-28451958

客户服务电话：4006515988

网址：<http://www.bhzq.com>

（23）中国国际金融有限公司

住所：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

基金代销业务联系人：任敏、陈曦、康楠

联系电话：010-65051166

传真：010-65058065



客户服务电话：400-910-1166

(24) 中泰证券股份有限公司

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.zts.com.cn

(25) 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：95321

公司网址：www.cindasc.com

(26) 江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

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

联系人：刘爽

电话：0451-85863719

传真：0451-82287211

客户服务热线：400-666-2288

网址：www.jhzq.com.cn

(27) 国都证券股份有限公司

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：王少华

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

(28) 德邦证券股份有限公司

住所：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：姚文平

联系人：朱磊

联系电话：862168761616-8507

传真：862168767981

（29）华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座

法定代表人：李工

公司电话：0551-65161666

传真：0551-65161600

网址：[www.hazq.com](http://www.hazq.com)

客户服务电话：95318、400-80-96518（全国）

（30）东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：朱科敏

电话：021-20333333

传真：021-50498825

客服电话：95531；400-8888-588

网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

（31）中航证券有限公司

注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：王宜四

联系人：史江蕊

联系电话：0791-86768681

客服电话：400-8866-567

公司网址：[www.avicsec.com](http://www.avicsec.com)

（32）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：魏庆华

电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

客服电话：4006000686

网址：www.nesc.cn

（33）中国中投证券有限责任公司

住所：深圳福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 座 18-21 层

法定代表人：龙增来

联系电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

联系人：刘毅

客服电话：400 600 8008、95532

网址：www.china-invs.cn

（34）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：0591-38162212

联系人：黄英

客户服务热线：95562

公司网站：www.xyzq.com.cn

（35）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：陈剑虹

客服电话：4008-001-001

公司网址：www.essence.com.cn

（36）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16 楼至 26 楼

法定代表人：何如

联系人：周杨

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客户服务热线：95536

国信证券网站：www.guosen.com.cn

(37) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路 336 号

办公地址：上海市西藏中路 336 号

法定代表人：龚德雄

联系人：许曼华

电话：021-53519888

传真：021-53519888

网址：www.962518.com

客户服务电话：4008918918、021-962518

(38) 东兴证券股份有限公司

公司名称：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

(39) 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

(40) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室（邮编：830002）

法定代表人：李季

电话：010-88085858

传真：010-88085195

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

联系人：王君

(41) 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：黄婵君

客户服务热线：4008888111、95565

公司网址：www.newone.com.cn

(42) 广发证券股份有限公司

法定代表人：孙树明

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

联系人：黄岚

统一客户服务热线：95575 或致电各地营业网点

公司网站：<http://www.gf.com.cn>

(43) 中信期货有限公司

地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

联系人：洪诚

电话：0755-23953913

传真：0755-83217421

客户服务电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

(44) 和讯信息科技有限公司

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

电话： 021-20835788

传真： 021-20835879

客户服务电话： 400-920-0022

公司网址： [licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

(45) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址： 深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006 邮政编码： 518028

法定代表人： 杨懿

电 话： 010-83363099

传 真： 010-83363010

客户服务电话： 400-166-1188

网址： <http://8.jrj.com.cn>

(46) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址： 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

办公地址： 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人： 薛峰

电话： 0755-33227950

传真： 0755-33227951

公司网址： [www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

客服热线： 4006-788-887

(47) 杭州数米基金销售有限公司

办公地址： 浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人： 陈柏青

电 话： 021-60897840

传 真： 0571-26697013

客服热线： 4000-766-123

公司网址： <http://www.fund123.cn/>

(48) 上海天天基金销售有限公司

注册地址： 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址： 上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人： 其实

电话： 021-54509998

传真： 021-64385308

公司网址： [www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

客户服务电话：400-1818-188

(49)浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

法定代表人：凌顺平

电话：0571-86800423

传真：0571-88910240

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

客服：4008-773-772

(50)宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

法人名称：沈伟桦

销售网站：[www.yixinfund.com](http://www.yixinfund.com)

客服电话：400-6099-200

(51)中经北证（北京）资产管理有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼 1 层

法人代表名称：徐福星

办公地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 1 号楼 1 层

电话：010-68998820

传真：010-88381550

客服电话：400-600-0030

网站：[www.bzfund.com](http://www.bzfund.com)

(52)上海好买基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东新区 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

电话：021-20613600

传真：021-68596919

客服热线：400-700-9665

好买基金交易网：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(53)上海陆金所资产管理有限公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法人代表：郭坚

电话：021-20665952

传真：021-22066653

公司网站: [www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

客户服务电话: 4008219031

(54) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址: 上海市长宁区福泉北路518号8座3层

法定代表人: 燕斌

电话: 021-52822063

传真: 021-52975270

客户服务电话: 4000-466-788

网站: [www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

(55) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址: 珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203

法人代表: 肖雯

电话: 020-89629099

传真: 020-89629011

客服电话: 020-89629066

网址: [www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

基金管理人可根据有关法律法规的要求选择其他机构代理销售基金, 并及时公告。

(二) 登记机构

名称: 华宝兴业基金管理有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心58楼

办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心58楼

电话: 021-38505888

传真: 021-38505777

联系人: 章希

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称: 上海市通力律师事务所

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: 俞卫锋

联系电话: (86 21) 3135 8666

传真: (86 21) 3135 8600



联系人：陆奇

经办律师：黎明、陆奇

#### （四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址：中国上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：曹阳

经办注册会计师：薛竞、曹阳

## 五、基金简介

基金名称：华宝兴业转型升级灵活配置混合型证券投资基金

基金类型：契约型开放式

## 六、基金的投资

### （一）投资目标

在严格控制风险的前提下，把握中国经济转型升级过程中所蕴含的投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。

### （二）投资范围

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、资产支持证券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：

本基金将基金资产的 0-95% 投资于股票资产，其中，投资于转型升级主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交

易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

### （三）投资策略

#### 1、大类资产配置策略

本基金采取积极的大类资产配置策略，通过宏观策略研究，综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、产业政策、以及市场流动性等方面因素，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类资产配置比例。

#### 2、股票投资策略

股票市场是国民经济的晴雨表，一个国家的经济转型和产业升级进程深刻影响着股市大势和不同行业个股的兴衰起伏。本基金将根据我国不同行业所处的发展阶段以及相关产业政策，借鉴其他国家在经济转型升级过程中产业变迁的经验，采用自上而下和自下而上相结合的方法，选择符合转型升级方向的优势行业和优质企业进行投资。

##### （1）转型升级主题界定

本基金将根据我国不同行业所处的发展阶段以及国家相关产业政策，借鉴其他国家在经济转型升级过程中产业变迁的经验，选择具备快速发展潜力的优势行业进行重点投资，具体包括：

1) 战略性新兴产业，是以重大技术突破和重大发展需求为基础，对经济社会全局和长远发展具有重大引领带动作用，知识技术密集、物质资源消耗少、成长潜力大、综合效益好的产业。包括但不限于节能环保、新一代信息技术、生物、高端装备制造、新能源、新材料、新能源汽车等产业。本基金将通过分析战略性新兴产业中结构性、周期性及制度性变动趋势，挖掘出对相关上市公司发展及转型影响的潜在因素，对受益的行业和公司进行投资；

2) 现代服务业，是指伴随着信息技术和知识经济的发展产生，用现代化的新技术、新业态和新服务方式改造传统服务业，创造需求，引导消费，向社会提供高附加值、高层次、知识型的生产服务和生活服务的服务业。现代服务业的发展本质来自于社会进步、经济发展、社会分工的专业化等需求，具有智力要素密集度高、产出附加值高、资源消耗少、环境污染少等特点。现代服务业既包括新兴服务业，也包括对传统服务业的技术改造和升级，其本质是实现服务业的现代化。本基金将跟踪分析经济转型带来的消费结构升级变化趋势，不断发掘现代服务业中相关行业各子行业的投资机会，根据国家产业政策对服务行业相关上市公司的影响，以及服务行业各个子行业以及对应的企业所处的不同阶段（创业期、成长期、成熟期和衰退期），挑选出处于成长期、业绩能够超过行业平均水平的上市公司；

3) 传统产业中积极转型升级的公司。这里所指的转型，包括新产品开发、重大技术

变革、产业边界突破、商业模式转变。其中，新产品开发是指生产新产品、提供新服务等；重大技术变革是指应用新知识、新技术、新工艺实现产品质量的提高、产品成本的降低；产业边界突破是指在技术边界、业务边界、运作边界、市场边界的突破；商业模式转变是指企业在商业模式、市场营销、管理体系、生产流程等方面的变化和创新，以实现企业盈利增加和竞争实力的增强。

如果未来基金管理人认为有更适当的转型升级主题上市公司界定标准，本基金将根据实际情况对转型升级主题上市公司的界定方法进行变更。

## （2）个股选择

本基金将采取“自上而下”和“自下而上”相结合的精选策略，深入研究宏观经济以及所属行业的中观发展趋势，对受益于国家经济转型和产业升级方向的相关上市公司进行系统分析，综合分析其成长能力和投资价值，筛选出投资标的并构建投资组合。

## 3、固定收益类投资工具投资策略

本基金将投资于债券、货币市场工具和资产支持证券等固定收益率投资工具，以有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

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，需综合评价个券收益率、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。

## 4、权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下，主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，在风险可控的前提下力争实现稳健的超额收益。

## 5、股指期货投资策略

本基金将依据法律法规并根据风险管理的原则参与股指期货投资。本基金将通过对证券市场 and 期货市场运行趋势的研究，采用流动性好、交易活跃的期货合约，并充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征。

## 6、资产支持证券投资策略

本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

## 7、其他金融工具投资策略

如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他金融产品，基金管理人将根据监管机构的规定及本基金的投资目标，制定与本基金相适应的投资策略、比例限制、信息披露方式等。

### （四）投资管理

#### 1、决策依据

本基金主要依据下列因素决定基金资产配置和具体证券的买卖：

- （1）国内外宏观经济环境及其对中国证券市场的影响；
- （2）国家货币政策、产业政策以及证券市场政策；
- （3）转型升级主题上市公司的发展状况和跟踪调研结果；
- （4）国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。

#### 2、投资决策流程

##### （1）投资决策机制

公司的投资决策实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制，由基金经理根据投资决策委员会的授权具体承担基金管理工作。投资总监负责监督管理基金日常投资活动。公司投资决策机制为分级授权机制，即：

第一级，投资决策委员会。审定基金经理的投资组合配置提案和重点投资；

投资决策委员会是公司基金投资的最高决策机构，以定期或不定期（会议频率每月不少于一次）会议的形式讨论和决定基金投资的重大问题。

第二级，投资研究联席会议。确定投资组合配置提案。

研究部、投资管理部定期或不定期（会议频率双周一次或更多）召开投资—研究联席会议，研究、交流投资信息，探讨、解决投资业务的有关问题。双周投资—研究联席会议就研究部提交的全市场模拟组合与配置、宏观及行业策略，以及研究员提交的各行业模拟组合、三级股票池、重点投资品种等进行充分讨论。基金经理根据联席会议的成果及自身判断确定投资组合配置提案。

第三级，基金经理。在各自的权限内执行和优化组合配置方案。

##### （2）投资流程

###### 1) 投资决策委员会负责投资决策

投资决策委员会定期和不定期召开会议，负责就基金重大战略、资产配置做出决策。

###### 2) 研究人员负责投资研究和分析

研究人员根据自身以及其他研究机构的研究成果，构建初选股票池和策略精选股票池，

就基金的股票、债券、现金比例和个股买卖提出建议。

### 3) 基金经理小组负责投资执行

基金经理小组根据宏观经济和行业发展，提出投资组合的资产配置比例建议，同时结合股票排序和研究员的报告，形成投资计划提交投资决策委员会，并根据投资决策委员会的决策，具体实施投资计划。

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

### 4) 绩效评估

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

### 5) 内部控制

内部控制委员会、督察长、副总经理、监察稽核部和风险管理部负责内控制度的制定，并检查执行情况。

#### (五) 业绩比较基准

中证 800 指数收益率×55% + 上证国债指数收益率×45%

本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，与基金托管人协商一致后变更业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

#### (六) 风险收益特征

本基金是一只主动投资的混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

#### (七) 投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 本基金投资于股票的比例为基金资产的 0-95%，投资于转型升级主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；
- (2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；
- (3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- (7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的

0.5%;

(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

(9) 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%；

(10) 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%；

(11) 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%；

(12) 本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

(13) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(14) 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%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

(15) 本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；

2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%。其中，有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

5) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

(16) 本基金资产总值不得超过本基金资产净值的140%；

(17) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券/期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管机构取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定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，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 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；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

(八) 基金管理人代表基金行使股东权利和债权人权利的处理原则及方法

- 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利和债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2、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；
- 3、有利于基金财产的安全与增值；
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任

何不当利益。

#### （九）基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至 2016 年 3 月 31 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 131,559,982.02 15.60

其中：股票 131,559,982.02 15.60

2 基金投资 --

3 固定收益投资 --

其中：债券 --

资产支持证券 --

4 贵金属投资 --

5 金融衍生品投资 --

6 买入返售金融资产 330,000,000.00 39.13

其中：买断式回购的买入返售金融资产 --

7 银行存款和结算备付金合计 381,674,124.07 45.25

8 其他资产 198,015.55 0.02

9 合计 843,432,121.64 100.00

##### 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 采矿业 --

C 制造业 96,651,229.01 18.98

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 --

E 建筑业 --

F 批发和零售业 14,773,443.19 2.90

G 交通运输、仓储和邮政业 --

H 住宿和餐饮业 --

I 信息传输、软件和信息技术服务业 8,976,708.00 1.76

J 金融业 --

K 房地产业 2,235,100.00 0.44



|                 |                      |
|-----------------|----------------------|
| L 租赁和商务服务业      | --                   |
| M 科学研究和技术服务业    | --                   |
| N 水利、环境和公共设施管理业 | 1,111,988.88 0.22    |
| O 居民服务、修理和其他服务业 | --                   |
| P 教育            | --                   |
| Q 卫生和社会工作       | --                   |
| R 文化、体育和娱乐业     | 7,811,512.94 1.53    |
| S 综合            | --                   |
| 合计              | 131,559,982.02 25.83 |

### 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  | 002665 | 首航节能 | 712,300 | 19,623,865.00 | 3.85         |
| 2  | 300409 | 道氏技术 | 214,450 | 14,207,312.50 | 2.79         |
| 3  | 002462 | 嘉事堂  | 367,627 | 13,591,170.19 | 2.67         |
| 4  | 002188 | 巴士在线 | 293,700 | 9,841,887.00  | 1.93         |
| 5  | 300031 | 宝通科技 | 391,046 | 9,459,402.74  | 1.86         |
| 6  | 600303 | 曙光股份 | 731,763 | 9,417,789.81  | 1.85         |
| 7  | 300356 | 光一科技 | 180,031 | 7,939,367.10  | 1.56         |
| 8  | 300144 | 宋城演艺 | 266,969 | 7,811,512.94  | 1.53         |
| 9  | 002551 | 尚荣医疗 | 261,164 | 6,479,478.84  | 1.27         |
| 10 | 603308 | 应流股份 | 224,108 | 5,522,021.12  | 1.08         |

### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

### 5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

### 6、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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
本基金未投资股指期货。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策  
本基金未投资股指期货。

#### 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策  
本基金未投资国债期货。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金未投资国债期货。

(3) 本期国债期货投资评价  
本基金未投资国债期货。

#### 11、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十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) 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他资产构成

序号 名称 金额（元）

1 存出保证金 50,068.04

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 133,670.12

5 应收申购款 14,277.39

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 198,015.55

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 七、基金的业绩

本基金业绩数据截止日为 2016 年 3 月 31 日。本报告中所列数据未经审计。

### 1、净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率

① 净值增长率标准差

② 业绩比较基准收益率

③ 业绩比较基准收益率标准差

④ ①-③ ②-④

2015/12/15-2016/03/31 0.10% 0.51% -6.90% 1.34% 7.00% -0.83%

### 2、自基金合同生效以来基金份额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

华宝兴业转型升级灵活配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015 年 12 月 15 日至 2016 年 3 月 31 日)

注：1、本基金基金合同生效于 2015 年 12 月 15 日，截止 2016 年 3 月 31 日本基金基金合同生效未满一年。

2、按照基金合同的规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至 2016 年 3 月 31 日，本基金尚处于建仓期。

## 八、基金份额的申购和赎回

### (一) 申购与赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构参见本招募说明书“五、相关服务机构”部分相关内容或其他相关公告。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

### (二) 申购与赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资者在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要

求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金自 2016 年 2 月 22 日起开始办理日常申购、赎回业务。基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

### （三）申购与赎回的原则

- 1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；
- 2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；
- 3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；
- 4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资者认购、申购的先后次序进行顺序赎回。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### （四）申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

投资者必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

#### 2、申购和赎回的款项支付

投资者申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资者交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。

投资者赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日)，在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资者应在 T+2 日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资者。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

#### (五) 申购与赎回的数量限制

##### 1、申请申购基金的金额

通过其他销售机构和直销 e 网金申购本基金单笔最低金额为 100 元人民币(含申购费)。通过直销柜台首次申购的最低金额为 10 万元人民币(含申购费)，追加申购最低金额为每笔 100 元人民币(含申购费)。已在基金管理人直销柜台购买过基金管理人管理的其他基金的投资者，不受直销柜台首次申购最低金额的限制，但受追加申购最低金额的限制。各销售机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

其他销售机构的投资者欲转入直销柜台进行交易要受直销柜台最低金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整首次申购的最低金额。

投资者可多次申购，对单个投资者累计持有份额不设上限限制。

##### 2、申请赎回基金的份额

投资者可将其全部或部分基金份额赎回。本基金按照份额进行赎回，申请赎回份额精确到小数点后两位，单笔赎回份额不得低于 100 份。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构保留的基金份额余额不足 100 份的，在赎回时需一次全部赎回。

3、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制、投资者每个基金交易账户的最低基金份额余额限制、单个投资者累计持有的基金份额上限等。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

#### (六) 申购费与赎回费

##### 1、申购费

本基金采取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 0.5%

大于等于 100 万，小于 200 万 1.0%

大于等于 50 万，小于 100 万 1.2%

50 万以下 1.5%

申购费用由投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记费等各项费用。

## 2、赎回费

本基金的赎回费率随基金持有时间的增加而递减。本基金的赎回费率表如下：

持有基金份额期限 赎回费率(%)

小于 7 日 1.50%

大于等于 7 日，小于 30 日 0.75%

大于等于 30 日，小于 1 年 0.50%

大于等于 1 年，小于 2 年 0.25%

大于等于 2 年 0

注：此处一年按 365 日计算

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对于收取的持续持有期少于 30 日的投资者的赎回费，基金管理人将其全额计入基金财产。对于收取的持续持有期长于等于 30 日但少于 3 个月的投资者的赎回费，基金管理人将不低于其总额的 75% 计入基金财产。对于收取的持续持有期长于等于 3 个月但少于 6 个月的投资者的赎回费，基金管理人将不低于其总额的 50% 计入基金财产。对持续持有期长于 6 个月的投资者，应当将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产，其余用于支付登记结算费和其他必要的手续费。

注：此处 1 个月按 30 日计算

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

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，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。

### （七）申购份额、赎回金额与基金份额净值的计算

#### 1、申购份额的计算方式

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

申购费用适用比例费率的情形下：

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/T 日基金份额净值

申购费用适用固定金额的情形下：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/T 日基金份额净值

申购份额的计算结果均按舍去尾数方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。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资产承担。

例：假定 T 日基金份额净值为 1.086 元，某投资者当日投资 10 万元申购本基金，对应的本次前端申购费率为 1.5%，该投资者可得到的基金份额为：

净申购金额=100000/（1+1.5%）=98522.17 元

申购费用=100000-98522.17=1477.83 元

申购份额=98522.17/1.086=90720.23 份

即：投资者投资 10 万元申购本基金，假定申购当日基金份额净值为 1.086 元，可得到 90720.23 份基金份额。

#### 2、赎回金额的计算方式

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

赎回总额=赎回份额×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者赎回本基金 1 万份基金份额，持有时间为两年三个月，对应的赎回费率为 0%，假设赎回当日基金份额净值是 1.150 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=10000×1.150=11500.00 元

赎回费用=11500×0%=0 元

赎回金额=11500-0=11500.00 元

即：投资者赎回本基金 1 万份基金份额，持有期限为两年三个月，假设赎回当日基金份额净值是 1.150 元，则其可得到的赎回金额为 11,500.00 元。

3、本基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

#### （八）申购与赎回的登记

- 1、经基金销售机构同意，基金投资者提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。
- 2、投资者 T 日申购基金成功后，基金登记机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理登记手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。
- 3、投资者 T 日赎回基金成功后，基金登记机构在 T+1 日为投资者扣除权益并办理相应的登记手续。
- 4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在指定媒介上公告。

#### （九）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资者的申购申请。
- 3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、基金管理人接受某笔或某些申购申请会损害现有基金份额持有人利益时。
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。
- 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、7 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### （十）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形



发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项。
- 3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- 5、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资者的赎回申请。
- 6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

#### （十一）巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为因支付投资者的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人应当在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10% 的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资者在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，

直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。

#### (十二) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

2、暂停申购或赎回期间结束，基金重新开放时，基金管理人应迟于重新开放日依法公告。

#### (十三) 基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

#### (十四) 基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

#### (十五) 基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资者。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给

其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

#### （十六）基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

#### （十七）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资者在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

#### （十八）基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

### 九、基金的费用与税收

#### （一）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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券/期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的开户费用、账户维护费用；
- 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。

#### （二）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1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

## 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0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

上述“（一）基金费用的种类中第3—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。

### （三）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；
- 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。

### （四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十、《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》）、《公开募集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《华宝兴业转型升级灵活配

置混合型证券投资基金招募说明书》作如下更新：

- 1、“三、基金管理人”更新了基金管理人的相关信息。
- 2、“四、基金托管人”更新了基金托管人的相关信息。
- 3、“五、相关服务机构”更新了本基金代销机构的相关信息。
- 4、“六、基金的募集”更新了基金的募集情况。
- 5、“七、基金合同的生效”更新了基金合同生效的日期。
- 6、新增“九、与基金管理人管理的其他基金转换”本基金办理转换业务的销售机构及本基金与其他基金转换的相关信息。
- 7、“十、基金的投资”更新了截至 2016 年 3 月 31 日的基金的投资组合报告。
- 8、新增“十一、基金的业绩”截至 2016 年 3 月 31 日的基金业绩数据。
- 9、“二十二、对基金份额持有人的服务”更新了本基金办理定期定额投资计划的信息。
- 10、“二十三、其他应披露事项”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,须与本基金《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

2016 年 7 月 27 日