

华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金招募说明书

(更新) 摘要

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

【重要提示】

本基金根据中国证券监督管理委员会《关于同意华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2008]956号)的核准,进行募集。基金合同于2008年10月7日正式生效。

基金管理人保证《华宝兴业大盘精选股票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核准,但中国证监会对本基金募集的核准,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。

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,由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险,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,等等。投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金招募说明书及《基金合同》。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

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》。

本招募说明书摘要所载内容截止日为 2016 年 10 月 7 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 9 月 30 日，数据未经审计。

一、《基金合同》生效日期

本基金自 2008 年 9 月 8 日到 2008 年 9 月 26 日向个人投资者和机构投资者同时发售，《基金合同》于 2008 年 10 月 7 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：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

电话：021-38505888

传真：021-38505777

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) 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 (黄小蕙) 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

夏林峰先生，曾在上海高压电器研究所有限公司担任信息专员。2010 年 7 月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后担任分析师、华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理助理等职务。2014 年 10 月 22 日起任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理。2015 年 2 月 17 日起任华宝兴业生态中国股票型证券投资基金基金经理。2015 年 6 月起任华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理：

冯刚先生，管理学硕士，2008 年 10 月至 2010 年 7 月担任本基金基金经理。

范红兵先生，硕士，2010 年 7 月至 2014 年 10 月担任本基金基金经理。

王智慧先生，博士，2012 年 1 月至 2015 年 11 月担任本基金基金经理。

5、 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。

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。

(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、 依法募集本基金，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、 编制中期和年度基金报告；
- 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、 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》、《证券法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》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) 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；

(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，本公司建立了一套完整的风险管理体系，具体包括以下内容：

(1) 搭建风险管理环境。具体包括制定风险管理战略、目标，设置相应的组织机构，建立清晰的责任线路和报告渠道、配备适当的人力资源、开发适用的技术支持系统等内容。

(2) 识别风险。辨识公司运作和基金管理中存在的风险。

(3) 分析风险。检查存在的控制措施，分析风险发生的可能性及其引起的后果并将风险归类。

(4) 度量风险。评估风险水平的高低，既有定性的度量手段，也有定量的度量手段。定性的度量是把风险水平划分为若干级别，每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别进入相应的级别。定量的方法则是设计一些风险指标，测量其数值的大小。

(5) 处理风险。将风险水平与既定的标准相对比，对于那些级别较低、在公司所定标准范围以内的风险，控制相对宽松一点，但仍加以定期监控，以防其超过预定标准；而对较为严重的风险，则制定适当的控制措

施；对于一些后果可能极其严重的风险，则除了严格控制以外，还准备了相应的应急处理措施。

(6) 监视与检查。对已有的风险管理系统进行实时监视，并定期评价其管理绩效，在必要时结合新的需求加以改变。

(7) 报告与咨询。建立风险管理的报告系统，使公司股东、公司董事会、公司高级管理人员及监管部门及时而有效地了解公司风险管理状况，并寻求咨询意见。

2、内部控制制度

(1) 内部风险控制原则

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门和各级岗位，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

有效性原则。通过设置科学清晰的操作流程，结合程序控制，建立合理的内控程序，保证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、市场开发等相关部门，应当在物理上和制度上适当隔离；对因业务需要必须知悉内幕信息的人员，应制定严格的批准程序和监督防范措施。

成本效益原则。公司应当充分发挥各部门及每位员工的工作积极性，尽量降低经营运作成本，保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律法规、规章制度和各项规定，并在此基础上遵循国际和行业的惯例制订。

全面性原则。内部控制制度必须涵盖公司经营管理的各个环节，并普遍适用于公司每一位员工，不留有制度上的空白或漏洞。

审慎性原则。公司内部控制的核心是风险控制，内部控制制度的制订要

以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

适时性原则。内部控制制度的制订应当具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改或完善。

（2）内部风险控制的要求和内容

内部风险控制要求不相容职务分离、建立完善的岗位责任制和规范的岗位管理措施、建立完整的信息资料保全系统、建立授权控制制度、建立有效的风险防范系统和快速反应机制。

内部风险控制的内容包括投资管理业务控制、市场管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制、档案管理控制、建立保密制度以及内部稽核控制等。

（3）督察长制度

公司设督察长，督察长由公司总经理提名，董事会聘任，并应当经全体独立董事同意。督察长的任免须报中国证监会核准。

督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告，并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长发现基金及公司运作中存在问题时，应当及时告知公司总经理和相关业务负责人，提出处理意见和整改建议，并监督整改措施的制定和落实；公司总经理对存在问题不整改或者整改未达到要求的，督察长应当向公司董事会、中国证监会及相关派出机构报告。

（4）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合规控制声明书

- (1) 本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；
- (2) 本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制。

三、基金托管人

(一) 基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

(二) 基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

(三) 证券投资基金托管情况

截至 2016 年 09 月 30 日，中国银行已托管 502 只证券投资基金，其中境内基金 471 只，QDII 基金 31 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007 年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”

“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2016 年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和

“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

四、 相关服务机构

（一） 基金份额销售机构

1、 直销机构：

(1) 直销柜台

本公司在上海开设直销柜台。

住所：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：021-38505888-301 或 302

直销柜台传真：021-50499663、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申购、赎回、转换等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上交易网址：www.fsfund.com。

2、代销机构

(1) 中国建设银行股份有限公司

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

(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

(3) 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：蒋超良

客户服务电话：95599

网址：www.95599.cn

(4) 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

(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

客户服务电话：95555

(6) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

联系电话：010-58560666

传真：010-57092611

联系人：杨成茜

客户服务电话：95568

公司网址: www.cmbc.com.cn

(7) 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 9 号

24 小时客户服务热线: 95558

网址: bank.ecitic.com

(8) 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

(9) 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

(10) 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

(11) 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

(12) 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

(13) 渤海银行股份有限公司

办公地址：天津市河东区海河东路 218 号渤海银行大厦

法定代表人：李伏安

网址：www.cbhb.com.cn

客户服务电话：95541

(14) 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

(15) 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

(16) 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

办公地址：上海市静安区新闻路 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

(17) 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

(18) 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

(19) 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

(20) 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

（21）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：广发证券网 <http://www.gf.com.cn>

（22）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

（23）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>

(24) 华泰证券股份有限公司

注册地址: 南京市江东中路 228 号

法定代表人: 吴万善

电话: 0755-82492193

传真: 0755-82492962

联系人: 庞晓芸

公司网址: www.htsc.com.cn

客户服务热线: 95597

(25) 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

联系人: 黄莹

(26) 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

客服电话: 95511-8

开放式基金业务传真: 0755-82435367

公司网址: www.stock.pingan.com

(27) 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

(28) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：胡月茹

电话：021-63325888

传真：021-63326729

客户服务热线：95503

公司网站：www.dfzq.com.cn

(29) 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

(30) 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

(31) 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

(32) 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

邮政编码: 200120

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>

(33) 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

网址: www.bocichina.com

传真: 021-50372474

(34) 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

(35) 长城证券股份有限公司

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：丁益

联系人：金夏

电话：021-62821733

客户服务热线：0755-33680000、400 6666 888

公司网址：www.cgws.com

(36) 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

电话：022-28451991

传真：022-28451958

客户服务电话：4006515988

网址：<http://www.bhzq.com>

(37) 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 座第 04 层、18-21 层

法定代表人：高涛

联系电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

联系人：张鹏

客服电话：95532

网址：www.china-invs.cn

(38) 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

(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：陈剑虹

客服电话：4008-001-001

公司网址：www.essence.com.cn

(40) 中国国际金融股份有限公司

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：金立群

基金代销业务联系人：罗春蓉、陈曦、康楠

联系电话：010-65051166

传真：010-65058065

客户服务电话：400-910-1166

(41) 民生证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层

法定代表人：余政

联系人：赵明

联系电话：010-85127622

联系传真：010-85127917

网址：www.msza.com

客户服务电话：4006198888

（42）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

（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：尹旭航

联系电话：010-63081493

传真：010-63081344

客服电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

（45）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：周俊

电话：0451-85863726

传真：0451-82337279

客户服务热线：400-666-2288

网址：www.jhzq.com.cn

（46）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

（47）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：魏庆华

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：李福春

电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

客服电话：4006000686

网址：www.nesc.cn

（49）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

客服电话：400-8888-128

公司网址：www.tebon.com.cn

（50）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

客户服务电话：95318、400-80-96518（全国）

（51）上海证券有限责任公司

注册地址：上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼上海市西藏中路
336 号

办公地址：上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：李俊杰龚德雄

联系人：邵珍珍许曼华

联系电话：021-53686888

客户服务电话：021-962518

传真：021-53686100，021-53686200

网址：www.962518.com

（52）方正证券股份有限公司

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.foundersec.com

（53）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：赵俊

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

客服电话：95531；400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

(54) 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：戴蕾

联系电话：0791-86768681

客服电话：400-8866-567

公司网址：www.avicsec.com

(55) 山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

联系人：郭熠

联系电话：0351-8686659

传真：0351-8686619

客户服务电话：400-666-1618、95573

公司网址：www.i618.com.cn

(56) 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:韩志谦

电话:0991-2307105

传真:0991-2301927

客户服务电话:400-800-0562

网址:www.hysec.com

联系人:王怀春

(57) 中信期货有限公司

注册地址: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

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

电话:0755-23953913

传真:0755-83217421

客户服务电话:400-990-8826

网址:www.citicsf.com

(58) 上海好买基金销售有限公司

办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室

法定代表人:杨文斌

电话:021-58870011

传真:021-68596919

客服热线:400-700-9665

好买基金交易网:www.ehowbuy.com

(59) 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 www.jjmmw.com

客服热线：4006-788-887

（60）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F

法定代表人：陈柏青

电话：021-60897840

传真：0571-26698533

客服热线：4000-766-123

公司网址：<http://www.fund123.cn/>

（61）上海天天基金销售有限公司

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

客户服务电话：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

（62）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

（63）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

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>

（64）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址： 上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址： 上海杨浦区秦皇岛路 32 号 C 栋 2 楼

法定代表人： 汪静波

联系人： 方成

联系电话： 021-38609777

公司网址： www.noah-fund.com

客户服务电话： 400-821-5399

（65）深圳腾元基金销售有限公司

注册地址： 深圳市福田区金田路 2028 号卓越世纪中心 1 号楼 1806-1810

办公地址： 深圳市福田区金田路 2028 号卓越世纪中心 1 号楼 1806-1810

法定代表人： 曾革

业务联系人： 鄢萌莎

联系电话： 0755-33376922

公司网址： www.tenyuanfund.com

客户服务电话： 4006-877-899

（66）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： 0571-88911818

传真： 0571-86800423

网址： www.5ifund.com

客服： 4008-773-772

（67）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

客服电话：400-6099-200

（68）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

网站：www.bzfunds.com

客服电话：400-600-0030

（69）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：鲍东华

电话：021-20665952

传真：021-22066653

公司网站：www.lufunds.com

客户服务电话：4008219031

（70）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

（71）上海万得投资顾问有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

法定代表人：王廷富

电话：021-51327185

传真：021-6888 2281

客服电话：400-821-0203

(72) 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

(73) 中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼

法定代表人：何亚刚

客服电话：4008895618

网址：<http://www.e5618.com>

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

(二) 注册登记机构：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：韩东霞

(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

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：张勇

经办注册会计师：薛竞、张勇

五、 基金名称

华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金

六、 基金类型

契约型开放式基金

七、 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

在控制风险的前提下，争取基金净值中长期增长超越业绩比较基准。

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，包括国内依法公开发行的、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资股票指数期货等其他品种，基金管理人在履行适当的程序后，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，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类资产配置比例。本基金的股票投资比例为基金资产净值的 60%-95%，其中投资于大盘股市值占非现金资产的比例不低于 80%，权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%，资产支持证券比例为基金资产净值的 0%-20%，债券及现金投资比例为基金资产净值的 5%-40%（其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于 5%）。本基金的大盘股指沪深 A 股按照流通市值从大至小排名在前 1/3 的股票。

（2）股票投资策略

本基金将深入研究大盘股基本面和长期发展前景，注重价值挖掘，精选个股。

1) 定量与定性相结合的个股精选策略

本基金的股票池主要包括大盘股。

在股票池中先用 7 个指标进行定量分析，这 7 个定量指标分别为：

成长指标：--预测未来两年 EPS 复合增长率

价值指标：--预测 P/E --预测 P/B

--预测 P/CF --预测 P/S

盈利指标：--过去三年平均 ROE

--过去三年平均 ROIC

筛选出排名靠前的股票形成初选股票池。

对初选股票池中的股票，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，精选符合以下一条或数条定性判断标准的股票，

形成备选股票池：

明显的规模经济和范围经济；

行业地位突出，强大的核心竞争力；

良好的管理能力和长远规划；

盈利能力强且注重股东回报和投资者关系；

公司治理完善、信息披露规范等。

2) 行业调整策略

通过对宏观经济、行业经济的把握以及对行业运行周期的认识，调整股票资产在不同行业的投资比例。

(3) 债券投资策略

本基金将通过大资产配置、分类资产配置和个券选择三个层次自上而下进行债券投资管理，以追求稳定收益和充分流动性的投资目标。

大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货币资产和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。

品种选择上，主要通过利率趋势分析、投资人偏好分析、对收益率曲线形态变化的预期、信用评估、市场收益率定价、流动性分析，筛选出流动性良好，成交活跃、符合目标久期、到期收益率有优势且信用风险较低的券种。

主要采用的投资策略包括：

1) 久期灵活管理：在对宏观经济趋势、金融货币政策和利率趋势的判断基础上，确定债券组合久期目标范围，在可接受范围内可以按照市场实际变化灵活管理久期长短，以获取市场超额收益。

2) 曲线合理定价：按照市场各品种实际成交情况，得出合理收益率曲线，使用该曲线对备选品种进行合理定价，确定其公允价格，在此基础上筛选出价格低于其合理价值的品种。

3) 曲线下滑策略：对收益率曲线形态进行分析，并预测其未来形态变化，选择收益率曲线段上斜率最高区间进行下滑操作，买入曲线上端品种，等待其剩余年期缩短而自然形成收益率下滑，从而得到超额下滑利润。

(4) 其他品种投资策略

本基金将根据市场的实际情况及基金的申购赎回状况，将部分资产投资于中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具，包括但不限于可转换债券、央行票据，捕捉市场机会，提高基金资产的使用效率。央行票据的投资策略见债券投资策略，可转换债券采用自上而下的两层次配置策略，在对宏观经济、行业分析的基础上，选择有成长性、前景看好的行业进行配置。最后落实到个股分析、转债具体条款分析、股性、债性分析上。利用转债的债性规避股市系统性风险和个股风险、追求投资组合的安全和稳定收益，并利用其股性在股市上涨中分享到行业和公司成长带来的收益。

另外，本基金具备投资权证的条件。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

4、业绩比较基准

本基金股票投资的业绩比较基准为沪深 300 指数，债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。整体业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times 80\% +$ 上证国债指数收益率 $\times 20\%$ 。

沪深 300 指数是第一个覆盖了沪深两市的交易所权威指数，具有市值覆盖率高、行业代表性强、流动性好等特点。

当市场出现更合适、更权威的比较基准时，经基金托管人同意，本基金管理人履行适当程序后，可选用新的比较基准，并将及时公告。

5、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。

（二）投资程序

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和资产配置做出决策。

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，定期将股票排名结果提交给研究部和基金经理。

3、研究部负责投资研究和分析

宏观研究人员通过研究其他证券公司和基金管理公司的报告，通过走访政府决策部门和研究部门，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）、重大技术发明等，撰写宏观研究报告，就基金的股票、债券、现金比例提出建议。

行业研究人员根据金融工程部定期提交的股票排名，以排名靠前的股票为主要研究对象，考察上市公司的基本面和长期发展前景，预测上市公司未来2—3年的经营情况，选择重点上市公司进行调研，撰写行业和子行业研究报告及上市公司调研报告，对个股买卖提出具体建议。

4、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，结合量化分析等工具对股市做出判断，提出投资组合的资产配置比例建议，同时结合数量分析模型的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。

经投资决策委员会和总经理审核投资组合方案后，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。

5、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 and 业绩贡献，由绩效评估人员利用相关工具评估。

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

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。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) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；
- (3) 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%；
- (4) 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%；
- (5) 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%；
- (6) 本基金股票、权证、债券、现金的投资比例范围为：股票占基金资产净值的60%—95%，权证占0%—3%，资产支持证券占0%—20%，债券及现金占5%—40%（其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于5%）；
- (7) 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%；
- (8) 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%；
- (9) 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%；
- (10) 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%；
- (11) 本基金投资的资产支持证券必须在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易；
- (12) 本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持

续信用评级。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，在持有期间如果其信用等级下降、不再符合投资标准，本基金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%；

(15) 保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

(16) 本基金资产总值不超过本基金资产净值的 140%；

(17) 法律法规或监管部门取消上述限制，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。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。对于因基金规模短期内快速增长而导致证券投资比例低于基金合同约定的，基金管理人可将调整时限从十个交易日延长到三个月。基金规模快速增长主要是指基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产规模在 10 个交易日内增加 10 亿元以上的情形。基金发生上述需延长建仓期限情形的，基金管理人应同基金托管人协商一致并及时向中国证监会基金监管部书面报告，说明上述情况出现的原因及解决方案。

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。

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。

(四) 基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

(五) 基金管理人代表基金行使股东权利的原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金财产的安全与增值；
- 3、独立行使股东权利，保护基金投资人的利益；
- 4、基金管理人按照有关规定代表基金出席上市公司股东大会，行使股东权利，履行股东义务。

八、 基金的投资组合报告

本基金的投资组合报告所载的数据截至 2016 年 9 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 85,080,254.67 82.44

其中：股票 85,080,254.67 82.44

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	--	
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	18,065,374.66	17.50
8 其他资产	61,893.60	0.06
9 合计	103,207,522.93	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	3,051,732.69	3.01
B 采矿业	--	
C 制造业	58,991,545.16	58.15
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	
E 建筑业	3,378,183.26	3.33
F 批发和零售业	10,427,737.00	10.28
G 交通运输、仓储和邮政业	1,311,910.00	1.29
H 住宿和餐饮业	--	
I 信息传输、软件和信息技术服务业	6,049,161.40	5.96
J 金融业	--	
K 房地产业	--	
L 租赁和商务服务业	829,217.16	0.82
M 科学研究和技术服务业	--	
N 水利、环境和公共设施管理业	--	
O 居民服务、修理和其他服务业	--	
P 教育	--	
Q 卫生和社会工作	1,040,768.00	1.03

R 文化、体育和娱乐业 --

S 综合 --

合计 85,080,254.67 83.87

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	002583	海能达	325,400	3,999,166.00	3.94
2	002665	首航节能	359,100	3,422,223.00	3.37
3	002589	瑞康医药	96,500	3,175,815.00	3.13
4	002236	大华股份	197,900	3,069,429.00	3.03
5	002299	圣农发展	121,923	3,051,732.69	3.01
6	600511	国药股份	93,300	2,894,166.00	2.85
7	002456	欧菲光	74,900	2,723,364.00	2.68
8	002421	达实智能	128,200	2,722,968.00	2.68
9	300136	信维通信	101,300	2,586,189.00	2.55
10	002325	洪涛股份	258,554	2,376,111.26	2.34

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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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投资。

8、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。

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) 大盘精选基金截至 2016 年 9 月 30 日持仓前十名证券中的首航节能(002665)于 2016 年 1 月 5 日收到北京证监局《关于对北京首航艾启威节能技术股份有限公司采取监管谈话行政监管措施的决定书》，因公司在财务核算、信息披露、内部控制等方面存在问题，予以监管谈话。此后于 2016 年 2 月 25 日收到深圳证券交易所中小板管理部出具的监管关注函（中小板关注函【2016】第 34 号），因公司在利润分配预案的具体理由、合理性，利润分配预案与公司业绩匹配的具体理由等方面披露不全，给予关注。

大盘精选基金截至 2016 年 9 月 30 日持仓前十名证券中的达实智能

(002421)于 2016 年 9 月 1 日收到深圳证券交易所中小板公司管理部下

发的《关于对深圳达实智能股份有限公司的关注函》（中小板关注函【2016】第147号），深交所对公司披露的上述利润分配及资本公积金转增股本预案表示关注。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和析，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人对上述股票的投资判断未发生改变。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余八名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

（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 56,239.56

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 3,977.12

5 应收申购款 1,676.92

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 61,893.60

（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

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 002665 首航节能 3,422,223.00 3.37 重大事项停牌

九、基金的业绩

基金业绩截止日为 2016 年 9 月 30 日，所列数据未经审计。

1、净值增长率与同期比较基准收益率比较：

阶段 净值增长率

① 净值增长率标准差

② 业绩比较基准收益率

③ 业绩比较基准收益率标准差

④ ①-③ ②-④

2008/10/07-2008/12/31 0.98% 0.21% -10.74% 2.39% 11.72% -2.18%

2009/01/01-2009/12/31 91.29% 1.71% 73.60% 1.64% 17.69% 0.07%

2010/01/01-2010/12/31 -3.18% 1.46% -9.12% 1.26% 5.94% 0.20%

2011/01/01-2011/12/31 -30.49% 1.14% -19.67% 1.04% -10.82%

0.10%

2012/01/01-2012/12/31 7.40% 1.16% 7.04% 1.02% 0.36% 0.14%

2013/01/01-2013/12/31 9.65% 1.39% -5.30% 1.11% 14.95% 0.28%

2015/01/01-2015/12/31 32.39% 2.89% 6.98% 1.99% 25.41% 0.90%

2016/01/01-2016/09/30 -17.65% 1.98% -9.45% 1.25% -8.20% 0.73%

2008/10/07-2016/09/30 97.02% 1.67% 56.80% 1.38% 40.22% 0.29%

2、自基金合同生效以来基金累计份额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：

华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2008 年 10 月 7 日至 2016 年 9 月 30 日)

注：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 4 月 7 日，本基金已达到基金合同规定的资产配置比例。

十、基金费用概览

(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) 因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- (4) 基金合同生效以后的信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金合同生效以后与本基金相关的会计师费和律师费；
- (7) 基金的资金汇划费用；
- (8) 按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。

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 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

(2) 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。

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。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

(3) 上述“1、基金费用的种类”中(3)到(8)项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

4、不列入基金费用的项目

本条第(一)款约定以外的其他费用，以及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等不列入基金费用。

5、基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，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 3 个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费

投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。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%

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。

本基金将采用外扣法计算申购费用及申购份额。其中，

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、赎回费

赎回费随基金持有时间的增加而递减，费率如下：

持有时间 费率

两年以内（含两年） 0.5%

两年一三年（含三年） 0.3%

三年以上 0%

本基金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。

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

净赎回金额=赎回总额－赎回费用

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额，净赎回金额为赎回金额扣除赎回费用的金额，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。

3、转换费

本基金与公司管理的其他基金转换，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。

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。

4、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。

5、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，经相关销售机构同意，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。

(三)其他费用

本基金其他费用根据相关法律法规执行。

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《华宝兴业大盘精选股票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,更新了基金管理人的相关信息。
- 2、“四、基金托管人”部分,更新了基金托管人的相关信息。
- 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,更新了本基金与其他基金转换的相关内容。
- 5、“十、基金的投资”部分,更新了截至 2016 年 9 月 30 日的基金的投资组合报告。
- 6、“十一、基金的业绩”部分,更新了截至 2016 年 9 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,更新了部分信息。

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

2016年11月16日