

华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金招募

说明书(更新)摘要 2017 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： 中国银行股份有限公司

重要提示

本基金根据 2014 年 7 月 23 日中国证券监督管理委员会证监许可 [2014] 737 号的注册，进行募集。

基金管理人保证《华宝兴业量化对冲策略混合型发起式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。本基金为特殊类型的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性，因此收益不一定能超越业绩比较基准。

本基金投资于证券、期货市场，基金净值会因为证券、期货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。另外，本基金还将面临市场中性策略产品的风格风险、投资策略有效性风险、量化模型及金融数据的风险、发起式基金自动终止的风险、因投资股指期货面临的杠杆风险、基差风险、展期时的流动性风险、盯市结算制度带来的现金管理风险、到期日风险、对手方风险、连带风险、未平仓合约不能继续持有的风险等特有的风险，详见本招募说明书的风险揭示部分。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》

，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人的风险承受能力相适应。

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》。

本摘要所载内容截止日为 2017 年 3 月 17 日，有关财务数据和净值表现数据截止日为 2016 年 12 月 31 日，财务数据未经审计。

一、 基金合同生效日

本基金基金合同生效日：2014 年 9 月 17 日

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

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责任公司持有 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；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

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。

4、本基金基金经理

徐林明先生，复旦大学经济学硕士，FRM，曾在兴业证券、凯龙财经（上海）有限公司、中原证券从事金融工程研究工作。2005年8月加入华宝兴业基金管理有限公司，曾任金融工程部数量分析师、金融工程部副总经理。2009年9月至2015年11月任华宝兴业中证100指数型证券投资基金基金经理，2010年2月起任量化投资部总经理，2010年4月至2015年11月任华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2014年6月任助理投资总监，2014年9月兼任华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金经理。2015年4月起任华宝兴业事件驱动混合型证券投资基金基金经理。2016年12月起兼任华宝兴业沪深300指数增强型发起式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、华宝兴业未来主导产业灵活配置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。

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，办理基金份额的发售和登记事宜；
- 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、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》、《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) 不得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）以及本基金其他特有风险，详见本招募说明书风险揭示部分。

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 12 月 31 日，中国银行已托管 534 只证券投资基金，其中境内基金 500 只，QDII 基金 34 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) 基金份额发售机构

1、直销机构:

(1) 直销柜台

本公司在上海开设直销柜台。

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

邮政编码: 200120

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

直销柜台传真: 021-50499663、50988055

(2) 直销 e 网金

投资者可以通过本公司直销 e 网金网上交易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。直销 e 网金网址:

www.fsfund.com。

2、代销机构:

(1) 中国银行股份有限公司

注册地址: 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

客户电话: 95566

公司网址: www.boc.cn

(2) 中国工商银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街55号

客户电话: 95588

公司网址: www.icbc.com.cn

(3) 中国建设银行股份有限公司

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1号院1号楼

客户电话: 95533

公司网址: www.ccb.com

(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

联系人: 曹榕

联系电话: (021) 58781234

传真：（021）58408483

客户电话：95559

公司网址：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

联系人：邓炯鹏

联系电话：0755—83198888

客户电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

（6）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

客户电话：95541

公司网址：www.cbhb.com.cn

（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

联系人：高天、姚磊

联系电话：021-61618888

传真：021—63604196

客户电话：95528

公司网址：www.spdb.com.cn

（8）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

联系人：蔡霆

联系电话：022-28451991

传真：022-28451958

客户电话：4006515988

公司网址：<http://www.bhzq.com>

（9）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

联系人：金夏

联系电话：021-62821733

客户电话：0755-33680000、400 6666 888

公司网址: www.cgws.com

(10) 长江证券股份有限公司

注册地址: 武汉市新华路特8号长江证券大厦

联系人: 奚博宇

联系电话: 027-65799999

传真: 027-85481900

客户电话: 95579 或 4008-888-999

公司网址: www.95579.com

(11) 北京创金启富投资管理有限公司

注册地址: 北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A

办公地址: 北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A

联系人: 李婷婷

联系电话: 400-6262-818

传真: 010-63583991

客户电话: 010-66154828-8038

公司网址: www.5irich.com

(12) 德邦证券股份有限公司

注册地址: 上海市普陀区曹阳路510号南半幢9楼

办公地址: 上海市福山路500号城建国际中心26楼

联系人: 朱磊

联系电话: 862168761616-8507

传真: 862168767981

客户电话: 400-8888-128

公司网址: www.tebon.com.cn

(13) 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

联系电话: 0431-85096517

传真: 0431-85096795

客户电话: 95360

公司网址: www.nesc.cn

(14) 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

联系人：胡月茹

联系电话：021-63325888

传真：021-63326729

客户电话：95503

公司网址：www.dfzq.com.cn

（15）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

联系人：王一彦

联系电话：021-20333333

传真：021-50498825

客户电话：95531；400-8888-588

公司网址：www.longone.com.cn

（16）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

联系人：方晓丹

联系电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

客户电话：95330

公司网址：<http://www.dwzq.com.cn>

（17）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

联系人：刘晨、李芳芳

联系电话：021-22169999

传真：021-22169134

客户电话：95525、4008888788、10108998

公司网址：www.ebscn.com

（18）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

客户电话：400-818-8118

公司网址：www.guodu.com

（19）中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

联系人：罗春蓉、陈曦、康楠

联系电话：010-65051166

传真：010-65058065

客户电话：400-910-1166

（20）国金证券股份有限公司

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

联系人：刘婧漪、贾鹏

联系电话：028-86690057、028-86690058

传真：028-86690126

客户电话：95310

公司网址：www.gjzq.com.cn

（21）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

联系电话：400-888-6628

客户电话：95521

公司网址：www.gtja.com

（22）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

联系人：周杨

联系电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客户电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

（23）海通证券股份有限公司

注册地址：上海淮海中路 98 号

联系人：李笑鸣

联系电话：021-23219000

客户电话：95553、400-8888-001 或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址：www.htsec.com

（24）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

联系人：陆敏

联系电话：400-700-9665

传真：021-68596919

客户电话：021-20613600

公司网址：www.ehowbuy.com

（25）和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

联系人：刘洋

联系电话：400-920-0022

传真：021-20835788

客户电话：021-20835879

公司网址：www.licaik.com

（26）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

联系电话：0551-65161666

传真：0551-65161600

客户电话：95318、400-809-6518（全国）

公司网址：www.hazq.com

（27）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

联系电话：021-68777222

传真：021-68777822

客户电话：400-820-9898，021-38929908

公司网址：<http://www.cnhbstock.com>

（28）华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

联系电话：0591-96326

客户电话：96326（福建省外请加拨 0591）

公司网址：www.hfzq.com.cn

（29）华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

联系人：庞晓芸

联系电话：0755-82492193

传真：0755-82492962

客户电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

(30) 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

联系人：周俊

联系电话：0451-85863726

传真：0451-82337279

客户电话：400-666-2288

公司网址：www.jhzq.com.cn

(31) 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

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

联系人：文雯

联系电话：400-166-1188

传真：010-83363099

客户电话：010-83363010

公司网址：<http://8.jrj.com.cn>

(32) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

办公地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

联系人：赵德赛

联系电话：4000988511

传真：010-89188000

客户电话：4000988511

公司网址：<http://kenterui.jd.com>

(33) 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

联系人：兰敏

联系电话：4000-466-788

传真：021-52975270

客户电话：021-52822063

公司网址：www.66zichan.com

（34）上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

联系人：程晨

联系电话：4008219031

传真：021-50783597

客户电话：021-20665952

公司网址：www.lufunds.com

（35）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

联系人：方成

联系电话：021-38609777

客户电话：400-821-5399

公司网址：www.noah-fund.com

（36）平安证券股份有限公司

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

联系人：周一涵

传真：0755-82435367

客户电话：95511-8

公司网址：www.stock.pingan.com

（37）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

客户电话：400-666-1618、95573

公司网址：www.i618.com.cn

(38) 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

办公地址：上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

联系人：邵珍珍

联系电话：021-53686888

传真：021-53686100，021-53686200

客户电话：021-962518

公司网址：www.962518.com

(39) 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

联系人：黄莹

联系电话：021-33389888

传真：021-33388224

客户电话：95523 或 4008895523

公司网址：www.swhysc.com

(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

联系人：王怀春

联系电话：0991-2307105

传真：0991-2301927

客户电话：400-800-0562

公司网址：www.hysec.com

(41) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

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

联系人：韩爱彬

联系电话：4000-776-123

传真：0571-26697013

客户电话：021-60897840

公司网址：<http://www.fund123.cn/>

（42）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

联系人：杨蕾

联系电话：400-1818-188

传真：021-64385308

客户电话：021-54509998

公司网址：www.1234567.com.cn

（43）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

办公地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

联系人：董一锋

联系电话：4008-773-772

传真：0571-86800423

客户电话：0571-88911818

公司网址：www.5ifund.com

（44）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

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座

联系电话：400-821-0203

传真：021-6888 2281

客户电话：021-51327185

（45）北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室

联系人：付文红

联系电话：010-62675979

传真：010-62675369

客户电话：010-62675369

公司网址：www.xincai.com

（46）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

客户电话：400-800-8899、95321

公司网址：www.cindasc.com

（47）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

联系人：夏中苏

联系电话：0591-38281963

客户电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

（48）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

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

联系人：宋欣怡

联系电话：400-6099-200

传真：010-85894285

客户电话：010-52855713

公司网址：www.yixinfund.com

（49）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

联系人：邓颜

联系电话：010-66568292

客户电话：95551、400-8888-888

公司网址：www.chinastock.com.cn

（50）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

联系人：黄婵君

联系电话：0755-82943666

客户电话：4008888111、95565

公司网址：www.newone.com.cn

（51）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

联系人：戴蕾

联系电话：0791-86768681

客户电话：400-8866-567

公司网址：www.avicsec.com

（52）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

办公地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼 1 层

联系人：陶涛

联系电话：400-600-0030

传真：010-68292941

客户电话：010-68292745

公司网址：www.bzfund.com

（53）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

联系人：吴阳

联系电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客户电话：95538

公司网址：www.zts.com.cn

（54）中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 座第 04 层、18-21 层

联系人：张鹏

联系电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

客户电话：95532

公司网址：www.china-invs.cn

(55) 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

联系人：权唐

联系电话：400-889-5548

客户电话：400-8888-108(免长途费)、95587

公司网址：www.csc108.com

(56) 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

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

联系人：洪诚

联系电话：0755-23953913

传真：0755-83217421

客户电话：400-990-8826

公司网址：www.citicsf.com

(57) 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）

联系人：顾凌

联系电话：010-60838888

传真：010-60833739

客户电话：95548

公司网址：www.cs.ecitic.com

(58) 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：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

联系人：赵艳青

联系电话：0532-85023924

传真：0532-85022605

客户电话：95548

公司网址：www.citicssd.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

联系人：童彩平

联系电话：400-678-8887

传真：0755-33227951

客户电话：0755-33227950

公司网址：www.zlfund.cn

（60）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

联系人：李孟军

联系电话：020-89629066

传真：020-89629011

客户电话：020-89629099

公司网址：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） 注册登记机构：华宝兴业基金管理有限公司（同上）

（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：安冬

经办律师：安冬、孙睿

（四） 会计师事务所和经办注册会计师

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：中国上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

执行事务合伙人：杨绍信

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：张振波

经办注册会计师：汪棣、张振波

五、 基金的名称

本基金名称：华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金

六、 基金的类型

本基金类型：契约型开放式

七、 基金的投资目标

在有效控制风险的基础上，运用股指期货等衍生工具对冲市场系统风险，追求基金资产的长期稳健增值。

八、 基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

基金的投资组合比例为：

本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%—120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类空头工具价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类多头工具价值的合计值。

每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，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。

在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

本基金不受证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条第（一）项、第（三）项及第（五）项的限制。

待基金参与融资融券、转融通业务及投资其他品种（包括但不限于：其他基金份额、期权、收益互换等）的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并有效控制风险的前提下，经与基金托管人协商一致后，参与该类业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时，基金参与融资融券、转融通业务及投资其他品种的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项，将按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，在对基金份额持有人利益无实质性影响的情况下，无需召开基金份额持有人大会决定。

九、基金的投资策略

1、资产配置策略

在资产配置方面，本基金主要运用股指期货等空头工具对持有的股票等权益类多头组合进行对冲操作，规避权益类多头组合的市场系统性风险；同时预留必要的现金，以应对保证金的增加要求或投资者的赎回申请。

2、股票投资策略

本基金主要采用量化行业配置模型和量化 Alpha 选股模型构建指数增强股票组合，严格控制运作风险，并根据市场变化趋势，定期对模型进行调整，以改进模型的有效性，最大化超额收益。

量化行业配置模型在参考相关指数的行业权重分布的基础上，结合行业景气度、投资时钟、行业动量和行业超跌偏离度等基本面和技术面模型，在整体风险水平可控的前提下，实现各行业权重的优化配置。

根据对中国证券市场运行特征的长期研究、投研团队的长期投资实践和大量历史数据的实证检验，基金管理人量化投资团队开发了量化 Alpha 选股模型。该模型现阶段主要考虑估值、成长、盈利质量、市场预期等基本面因子以及股权激励、并购、重要股东投资行为、业绩超预期等事件驱动因子，通过实证分析和动态跟踪，以超额收益的水平和稳定性为目标确定各因子的优化权重，根据该模型的综合评分结果，在各行业中选择股票构建股票投资组合。

当股票投资组合构建完成后，本基金将进一步根据组合内个股价格波动、风险收益变化、特殊事件等实际情况，动态优化个股权重，使股票组合的整体风险处于可控范围内。

3、空头工具投资策略

现阶段，本基金主要运用股指期货合约进行套期保值操作，规避市场系统性风险。在完全套保的理念下，本基金根据股票多头组合的市值计算股指期货合约卖单量，并根据市场变化对股指期货合约卖单量进行动态跟踪并适时调整。同时，综合考虑定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在不同股指期货合约之间进行动态配置，并适时进行合约展期操作，以求提高组合收益和套期保值的效果。

未来，在基金参与融资融券、转融通业务及投资期权等其他金融工具的相关规定颁布后，基金管理人将按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求，根据市场情况选择合适的空头工具对冲市场系统风险。

4、其他绝对收益策略

在主要利用市场中性策略获取 Alpha 收益的同时，本基金可根据市场情况的变化，适时运用其他绝对收益策略（如定向增发套利策略、并购套利策略、股指期货期现套利策略、股指期货跨期套利策略等），以求在控制市场系统性风险的前提下，进一步增强收益水平，降低收益波动性。

5、固定收益类投资工具投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于债券、货币市场工具和资产支持证券，以保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

6、其他金融工具投资策略

在法律法规许可的前提下，本基金可基于谨慎原则运用权证等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以更好地实现本基金的投资目标。

十、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准是一年期银行定期存款利率（税后）。

本基金属于追求绝对收益的市场中性策略产品，因此选择一年期银行定期存款利率（税后）作为本基金的业绩比较基准。

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。

十一、基金的风险收益特征

本基金为特殊类型的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性，因此收益不一

定能超越业绩比较基准。

十二、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 12 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 79,093,373.02 12.10

其中：股票 79,093,373.02 12.10

2 基金投资 --

3 固定收益投资 395,010.00 0.06

其中：债券 395,010.00 0.06

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 190,000,000.00 29.07

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 367,553,791.95 56.23

8 其他资产 16,612,356.36 2.54

9 合计 653,654,531.33 100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

（1）报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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 602,952.00 0.09

B 采矿业 3,338,715.00 0.51

C 制造业 25,614,057.08 3.94

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 2,594,264.66 0.40

E 建筑业 3,529,178.23 0.54

F 批发和零售业 3,725,395.57 0.57

G 交通运输、仓储和邮政业 1,309,562.68 0.20

H 住宿和餐饮业 --

I 信息传输、软件和信息技术服务业 1,912,160.00 0.29

J 金融业 28,083,344.80 4.31

K 房地产业 4,792,403.00 0.74
 L 租赁和商务服务业 2,013,720.00 0.31
 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 --
 R 文化、体育和娱乐业 1,577,620.00 0.24
 S 综合 --
 合计 79,093,373.02 12.15

(2) 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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 601318 中国平安 94,900 3,362,307.00 0.52
 2 000625 长安汽车 185,400 2,769,876.00 0.43
 3 000001 平安银行 266,400 2,424,240.00 0.37
 4 601939 建设银行 445,100 2,421,344.00 0.37
 5 600016 民生银行 266,500 2,419,820.00 0.37
 6 601166 兴业银行 148,600 2,398,404.00 0.37
 7 600000 浦发银行 145,480 2,358,230.80 0.36
 8 600015 华夏银行 215,300 2,336,005.00 0.36
 9 601211 国泰君安 122,200 2,271,698.00 0.35
 10 000686 东北证券 181,300 2,240,868.00 0.34

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 --
 2 央行票据 --
 3 金融债券 --
 其中：政策性金融债 --
 4 企业债券 --
 5 企业短期融资券 --

6 中期票据	--
7 可转债（可交换债）	395,010.00 0.06
8 同业存单	--
9 其他	--
10 合计	395,010.00 0.06

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

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

1	128013	洪涛转债	3,500	395,010.00	0.06
---	--------	------	-------	------------	------

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
----	----	----------	---------	-----------	------

IF1701	IF1701	-79	-78,020,400.00	2,847,540.00	-
--------	--------	-----	----------------	--------------	---

公允价值变动总额合计（元） 2,847,540.00

股指期货投资本期收益（元） -3,920,100.00

股指期货投资本期公允价值变动（元） 2,854,860.00

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金主要运用股指期货合约进行套期保值操作，规避市场系统性风险。在完全套保的理念下，本基金根据股票多头组合的市值计算股指期货合约卖单量，并根据市场变化对股指期货合约卖单量进行动态跟踪并适时调整。同时，综合考虑定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在不同股指期货合约之间进行动态配置，并适时进行合约展期操作，以求提高组合收益和套期保值的效果。

本基金投资于股指期货，为特殊类型的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金的投资符合既定的投资政策和投资目标。

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）量化对冲混合基金截至 2016 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的平安银行（000001）于 2016 年 12 月 2 日收到中国银行间市场交易商协会的通报批评和整改通知。因其作为主承销商，对青岛海湾集团有限公司未能按照相关自律规则的规定及时披露公司重大资产无偿划转相关事项，未能及时召开持有人会议，给予平安银行通报批评处分，责令平安银行立即纠正违规行为，并针对本次事件中暴露出的问题进行整改。

量化对冲混合基金截至 2016 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的建设银行（601939）于 2016 年 5 月 11 日收到甘肃证监局整改通知。因建设银行甘肃省分行营业部在基金销售过程中存在基金从业人员资质不符合法规要求以及销售适用性方面不符合法规要求的问题，责令其在 2016 年 5 月 31 日前予以改正并提交书面报告，等待组织检查验收。

量化对冲混合基金截至 2016 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的国泰君安（601211）于 2016 年 1 月 29 日收到全国中小企业股份转让系统公开谴责。因国泰君安以明显低于最近成交价的价格进行卖出申报，造成做市股票尾盘价格大幅波动，严重影响了对多只股票的正常转让价格，扰乱了正常市场秩序，决定给予国泰君安证券股份有限公司公开谴责。

国泰君安（601211）于 2016 年 2 月 16 日收到中国证券监督管理委员会上海监管局《中国证券监督管理委员会上海监管局行政监管措施事先告知书》（沪证监机构字[2016]22 号）。因其场外市场部做市业务部门的绩效考核体系、内部管理与控制方面等存在重大缺陷，导致 2015 年 12 月 31 日做市股票发生一系列报价异常事件，造成恶劣的市场影响。决定限制其新增做市业务三个月，并责令其在规定时间内，每 3 个月对做市业务部门开展一次内部合规检查，并在每次检查后

10个工作日内，向上海监管局书面报送合规检查报告。并于2016年2月26日，上海监管局《关于对国泰君安证券股份有限公司采取限制新增做市业务等监管措施的决定》（沪证监决[2016]15号）。

国泰君安（601211）于2016年6月29日收到中国证监会北京监管局警告。因其作为受托管理人，未能及时发现和制止违规的转借行为，违反了《公司债券发行与交易管理办法》第七条和第五十条第二款的规定，决定对公司采取出具警示函的行政监管措施。

国泰君安（601211）于2016年7月26日收到中国证券监督管理委员会上海监管局整改通知。因其作为国泰君安新利6号集合资产管理计划的资产管理人，投资决策和交易执行环节控制存在不足，发生相关异常交易。公司未能切实履行勤勉尽责的管理人义务，未能采取有效措施防范利益冲突，责令公司增加内部合规检查次数，并及时提交合规检查报告。

国泰君安（601211）于2016年8月26日收到中国证券监督管理委员会整改通知。因其内核机构履职的独立性存在缺陷，未在规定时间内完成并报送《持续督导现场检查工作报告》。并且在推荐企业进入全国中小企业股份转让系统挂牌过程中，对企业关键业务流程、购销情况的核查不充分。拟责令公司改正、增加内部合规检查次数并提交合规检查报告。

国泰君安（601211）于2016年8月26日收到中国证监会警告。因国泰君安在保荐金徽酒首发项目过程中，向中国证监会提交的会后事项承诺函中未如实说明发行人2015年利润分配情况，对发行人实施分红事项，未主动向我会履行告知义务，对国泰君安采取了出具警示函的行政监管措施。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和视为，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七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 15,636,196.69

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 704,788.15

5 应收申购款 271,371.52

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 16,612,356.36

(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。

十三、基金的业绩

基金业绩截止日为 2016 年 12 月 31 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：

华宝兴业量化对冲混合 A

阶段 份额净值增长率① 份额净值增长率标准差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

2014/09/17-2014/12/31 2.70% 0.53% 0.84% 0.01% 1.86% 0.52%

2015/01/01-2015/12/31 11.89% 0.45% 2.12% 0.01% 9.77% 0.44%

2016/01/01-2016/12/31 3.57% 0.03% 1.50% 0.00% 2.07% 0.03%

2014/09/17-2016/12/31 19.01% 0.35% 4.46% 0.01% 14.55% 0.34%

华宝兴业量化对冲混合 C

阶段 份额净值增长率① 份额净值增长率标准差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

2014/09/17-2014/12/31 2.70% 0.53% 0.84% 0.01% 1.86% 0.52%

2015/01/01-2015/12/31 11.64% 0.45% 2.12% 0.01% 9.52% 0.44%

2016/01/01-2016/12/31 3.94% 0.06% 1.50% 0.00% 2.44% 0.06%

2014/09/17-2016/12/31 19.17% 0.35% 4.46% 0.01% 14.71% 0.34%

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：

华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年9月17日至2016年12月31日)

十四、基金的费用

(一) 基金费用的种类

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) 《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) 销售服务费；
- (10) 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。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法

如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

（3）销售服务费

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。

C 类基金份额的销售服务费计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计值每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中划出，经登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类中第 3—8 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

4、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。

（二）与基金有关的销售费用

1、申购费与赎回费

(1) 申购费

对于本基金 A 类基金份额，投资人在申购时需交纳前端申购费；本基金 C 类基金份额不收取申购费。

A 类基金份额

申购金额 申购费率

M<100 万元 0.80%

100 万元≤M<500 万元 0.40%

M≥500 万元 按笔收取，1000 元/笔

C 类基金份额

申购费率为零

(2) 赎回费

本基金的赎回费随基金持有时间的增加而递减。本基金各类基金份额的赎回费率表如下：

A 类基金份额 C 类基金份额

持有基金份额期限 赎回费率(%) 赎回费率(%)

少于 7 日 1.5 1.0

大于等于 7 日，少于 30 日 0.75 0.75

大于等于 30 日，少于 6 个月 0.5 0.5

大于等于 6 个月 0 0

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 日的投资人的赎回费，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 个月的投资人的赎回费，基金管理人将不低于其总额的 75% 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。对于收取的持续持有期长于等于 3 个月但少于 6 个月的投资人的赎回费，基金管理人将不低于其总额的 50% 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。

法律法规调整上述归入比例的，从其规定。

(3) 基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率、赎回费率或收费方式。费率或收费方式如发生变更，基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

(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，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者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，

按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

2、申购份额、赎回金额与基金份额净值的计算

(1) 申购份额的计算方式

1) 当投资人选择申购 A 类基金份额时，申购份额的计算方法如下：

① 申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

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 A 类基金份额净值

② 申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

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 A 类基金份额净值

2) 当投资人选择申购 C 类基金份额时，申购份额的计算方法如下：

申购份额 = 申购金额 / T 日 C 类基金份额净值

申购费用、净申购金额按四舍五入方法，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，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例一：假定 T 日 A 类基金份额净值为 1.086 元，某投资人当日申购本基金 A 类基金份额 10 万元，该投资人可得到的基金份额为：

净申购金额 = $100000 / (1 + 0.8\%) = 99206.35$ 元

申购费用 = $100000 - 99206.35 = 793.65$ 元

申购份额 = $99206.35 / 1.086 = 91350.23$ 份

即：投资人投资 10 万元申购本基金 A 类基金份额，假定申购当日 A 类基金份额净值为 1.086 元，可得到 91350.23 份 A 类基金份额。

例二：假定 T 日 C 类基金份额净值为 1.086 元，某投资人当日申购本基金 C 类基金份额 10 万元，该投资人可得到的基金份额为：

申购份额 = $100000 / 1.086 = 92081.03$ 份

即：投资人投资 10 万元申购本基金 C 类基金份额，假定申购当日 C 类基金份额净值为 1.086 元，可得到 92081.03 份 C 类基金份额。

(2) 赎回金额的计算方式

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额的赎回金额的计算方式相同，按照各自对应的 T 日基金份额净值和赎回费率计算，赎回金额的计算方式如下：

赎回金额=赎回份额×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回金额×赎回费率

净赎回金额=赎回金额-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。

例三：某投资人赎回 1 万份本基金 A 类基金份额，持有时间为两个月，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.150 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回金额=10000×1.150=11500.00 元

赎回费用=11500×0.5%=57.50 元

净赎回金额=11500-57.50=11442.50 元

即：投资人赎回 1 万份本基金 A 类基金份额，持有时间为两个月，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.150 元，则其可得到的净赎回金额为 11442.50 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。

十五、《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《华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金招募说明书》作如下更新:

- 1、“三、基金管理人”更新了本基金基金管理人的相关信息。
- 2、“四、基金托管人”更新了本基金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、“九、与基金管理人管理的其他基金转换”更新了本基金与其他基金转换的相关信息。
- 5、“十、基金的投资”更新了本基金截至 2016 年 12 月 31 日的基金投资组合

报告。

6、“十一、基金的业绩”更新了本基金截至 2016 年 12 月 31 日的基金业绩数据。

7、“二十二、对基金份额持有人的服务”更新了定期定额投资的服务内容。

8、“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

2017 年 4 月 27 日