

华宝兴业先进成长混合型证券投资基金招募说明书摘要（更新）

基金管理人：华宝基金管理有限公司

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《关于同意华宝兴业先进成长混合型证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2006]200号)的核准，进行募集。基金合同于2006年11月7日正式生效。

基金管理人保证《华宝兴业先进成长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。

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。

投资有风险，投资人申购本基金时应认真阅读本基金招募说明书。

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2017年10月7日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年9月30日，数据未经审计。

一、《基金合同》生效日期

本基金自2006年10月12日到2006年11月3日向个人投资者和机构投资者同时发售，《基金合同》于2006年11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：孔祥清

总经理：HUANGXiaoyiHelen（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 WarburgPincusAssetManagement,L.P.持有 49% 的股份。

(二)主要人员情况

1、董事会成员

孔祥清先生，董事长，硕士，高级会计师。曾任宝钢计财部资金处主办、主管、副处长，宝钢集团财务有限公司总经理。现任华宝基金管理有限公司董事长、华宝投资有限公司副总经理、法兴华宝汽车租赁（上海）有限公司董事长、华宝信托有限责任公司董事、华宝都鼎（上海）融资租赁有限公司董事长、中国太平洋保险（集团）股份有限公司董事。

HUANGXiaoyiHelen（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 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任公司营运总监、董事会秘书、副总经理，现任华宝基金管理有限公司总经理。

MichaelMartin 先生，董事，博士。曾任 WachtellLiptonRosenKatz 律师助理；第一波士顿银行董事总经理；瑞银证券董事总经理；BrooklynNYHoldings 总裁；现任美国华平投资集团全球执行委员会成员、全球金融行业负责人、董事总经理，美国 FinancialEngines 董事、加拿大 DBRS 董事、美国 MarinerFinance 董事。

周朗朗先生，董事，本科。曾任瑞士信贷第一波士顿（加拿大）分析师；花旗银行（香港）投资银行部分析师；现任美国华平集团中国金融行业负责人、董事总经理，华融资产管理股份有限公司董事，上海灿谷投资管理咨询服务有限公司董事。

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，华彬国际投资（集团）有限公司高级顾问。

2、监事会成员

朱莉丽女士，监事，硕士。曾就职于美林投资银行部、德意志银行投资银行部；现任美国华平集团执行董事。

杨莹女士，监事，本科。曾在三九集团、中国平安保险（集团）股份有限公司、永亨银行（中国）有限公司、中国民生银行工作，现任华宝投资有限公司风控合规部总经理。

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；现任华宝基金管理有限公司营运副总监。

王波先生，监事，硕士。曾任上海证券报记者；现任华宝基金管理有限公司市场总监兼战略策划部总经理。

3、总经理及其他高级管理人员

孔祥清先生，董事长，简历同上。

HUANGXiaoyiHelen（黄小薏）女士，总经理，简历同上。

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 年加入华宝基金管理有限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，现任华宝基金管理有限公司副总经理。

欧江洪先生，副总经理，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、华宝投资有限公司总经理助理兼行政人事部总经理、党委组织部部长，党委办公室主任、董事会秘书等职务。现任华宝基金管理有限公司副总经理。

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。现任华宝基金管理有限公司督察长。

4、本基金基金经理

季鹏先生，硕士研究生，具有 CFA、FRM 资格。曾在香港大福证券、光大保德信基金管理有限公司从事行业研究、投资管理工作。2011 年 4 月加入华宝兴业基金管理有限公司任高级策略分析师兼基金经理助理的职务。2013 年 8 月起任华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理。2015 年 5 月起任华宝兴业先进成长混合型证券投资基金基金经理。2015 年 5 月起任华宝兴业国策导向混合型证券投资基金基金经理。

本基金的历任基金经理：魏东先生，其任职时间为 2006 年 11 月至 2009 年 5 月；吴丰树先生，其任职时间为 2009 年 5 月至 2011 年 2 月；李靖先生，其任职时间为 2011 年 2 月至 2013 年 2 月；朱亮先生，其任职时间为 2012 年 6 月至 2015 年 5 月。

5、投资决策委员会成员

刘自强先生，投资总监、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、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，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、华宝兴业智慧产业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。

蔡目荣先生，国内投资部副总经理、华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金经理、华宝兴业资源优选混合型证券投资基金基金经理。

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它职责。

(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，防止违法违规行为的发生。

2、基金管理人不得从事下列行为：

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；

不公平地对待其管理的不同基金财产；

利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

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：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：陈四清

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2017年09月30日，中国银行已托管637只证券投资基金，其中境内基金600只，QDII基金37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、AAF01/06ISAE3402和SSAE16等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017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。

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

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网上交易系统直销 e 网金办理本基金的申购、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）中国工商银行股份有限公司

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

（2）中国农业银行股份有限公司

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

客户电话：95599

公司网址：www.95599.cn

（3）中国银行股份有限公司

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

（4）中国建设银行股份有限公司

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

（5）交通银行股份有限公司

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

(6) 招商银行股份有限公司

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

(7) 兴业银行股份有限公司

客户电话：95561 或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址：<http://www.cib.com.cn>

(8) 中国民生银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

联系人：杨成茜

联系电话：010-58560666

传真：010-57092611

客户电话：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

(9) 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

(10) 广发银行股份有限公司

办公地址：广东省广州市农林下路 83 号

客户电话：800-830-8003；400-830-8003

公司网址：www.gdb.com.cn

(11) 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

客户电话：95577

公司网址：www.hxb.com.cn

(12) 江苏银行股份有限公司

客户电话：96098，40086-96098

公司网址：www.jsbchina.cn

(13) 平安银行股份有限公司

联系人：张莉

联系电话：021-38637673

传真：021-50979507

客户电话：95511-3

公司网址：bank.pingan.com

(14) 上海浦东发展银行股份有限公司

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

(15) 中信银行股份有限公司

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

联系人：陈国媚

客户电话：95558

公司网址：bank.ecitic.com

（16）安信证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 号楼 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：杨天枝

联系电话：0755-82558323

传真：0755-82558355

客户电话：4008-001-001

公司网址：www.essence.com.cn

（17）渤海证券股份有限公司

办公地址：天津市南开区云际道立达公寓 F 座渤海证券

法定代表人：王春峰

联系人：王星

联系电话：022-28451922

客户电话：4006515988

公司网址：www.ewww.com.cn

（18）长城证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16-17 层

法定代表人：丁益

联系人：金夏

联系电话：0755-83516289

客户电话：400-6666-888

公司网址：www.cgws.com/cczq/

（19）长江证券股份有限公司

办公地址：湖北省武汉市新华路特 8 号

法定代表人：尤习贵

联系人：奚博宇、黄美慧

联系电话：021-68751860；027-65799827

客户电话：95579 或 4008-888-999

公司网址：www.95579.com

（20）北京蛋卷基金销售有限公司

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

联系电话：010-61840688

传真：010-61840699

客户电话：4000618518

公司网址：https://danjuanapp.com/

（21）德邦证券股份有限公司

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：刘熠

联系电话：68761616-8076

传真：862168767981

客户电话：400-8888-128

公司网址：www.tebon.com.cn

（22）东北证券股份有限公司

办公地址：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

联系人：付静雅

联系电话：0431-82006251

传真：0431-85096795

客户电话：95360

公司网址：www.nesc.cn

（23）东方证券股份有限公司

办公地址：上海市中山南路 318 号东方国际金融广场 2 号楼 21-29 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：黄静

联系电话：63325888-3137

传真：021-63326729

客户电话：95503

公司网址：www.dfzq.com.cn

（24）东海证券股份有限公司

办公地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

法定代表人：朱科敏

联系人：王一彦

联系电话：20333910

传真：021-50498871

客户电话：95531

公司网址：www.longone.com.cn

（25）东吴证券股份有限公司

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

联系人：陆晓

联系电话：0512-62938521

传真：0512-65588021

客户电话：95330

公司网址：www.dwzq.com.cn

（26）东兴证券股份有限公司

联系人：汤漫川

联系电话：010-66555316

传真：010-66555246

客户电话：400-8888-993

公司网址：www.dxzq.net.cn

（27）方正证券股份有限公司

办公地址：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：何其聪

联系人：齐冬妮

联系电话：010-59355807

客户电话：95571

公司网址：www.foundersc.com

（28）光大证券股份有限公司

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号 3 楼

法定代表人：薛峰

联系人：李晓哲、姚巍、李芳芳

联系电话：021-22169111、021-22169502

传真：021-22169134

客户电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

（29）广发证券股份有限公司

办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 18 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

联系电话：020-87555888-8333

客户电话：95575 或致电各地营业网点

公司网址：www.gf.com.cn

（30）国都证券股份有限公司

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层

法定代表人：王少华

联系人：李弢

联系电话：010-84183331

客户电话：400-818-8118

公司网址：www.guodu.com

（31）中国国际金融股份有限公司

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

（32）国泰君安证券股份有限公司

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

法定代表人：杨德红

联系人：钟伟镇

联系电话：38032284

传真：021-38670666

客户电话：95521、4008888666

公司网址：www.gtja.com

（33）国信证券股份有限公司

办公地址：深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦

法定代表人：何如

联系人：李颖

联系电话: (0755)82130833--701266、(0755)82133066

传真: 0755-82133952

客户电话: 95536

公司网址: www.guosen.com.cn

(34) 国元证券股份有限公司

客户电话: 4008888777 或 95578

公司网址: www.gyzq.com.cn

(35) 海通证券股份有限公司

办公地址: 上海广东路 689 号

法定代表人: 周杰

联系人: 李楠、涂洋

联系电话: 23219061、23219290

客户电话: 95553

公司网址: www.htsec.com

(36) 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

联系人: 陆敏

联系电话: 021-20613600

传真: 021-68596919

客户电话: 400-700-9665

公司网址: www.ehowbuy.com

(37) 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

联系人: 刘洋

联系电话: 021-20835879

传真: 021-20835788

客户电话: 400-920-0022

公司网址: www.licaike.com

(38) 恒泰证券股份有限公司

办公地址: 内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

联系人: 王旭华

联系电话: 0471-4972343

客户电话: 400-196-6188

公司网址: www.cnht.com.cn

(39) 申万宏源西部证券有限公司

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

法定代表人: 李季

联系人: 黄莹

联系电话: 021-33388211

传真: 0991-2301927

客户电话: 400-800-0562

公司网址: www.swhysc.com

(40) 华安证券股份有限公司

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 0327 室

法定代表人：李工

联系人：樊忠亚

联系电话：0551-65161675

传真：0551-65161672

客户电话：95318

公司网址：www.hazq.com

（41）华宝证券有限责任公司

办公地址：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

联系人：胡星煜

联系电话：20515583

传真：021-20515593

客户电话：400-820-9898，021-38929908

公司网址：www.cnhbstock.com

（42）华宝直销

联系电话：021-38505888-731/732

（43）华福证券有限责任公司

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

（44）华泰证券股份有限公司

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

联系电话：0755-82492193

客户电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

（45）江海证券有限公司

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

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

（46）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

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：010-83363010

传真：010-83363099

客户电话：400-166-1188

公司网址：http://8.jrj.com.cn

（47）北京肯特瑞财富投资管理有限公司

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>

（48）上海联泰资产管理有限公司

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：021-52822063

传真：021-52975270

客户电话：4000-466-788

公司网址：www.66zichan.com

（49）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

联系人：程晨

联系电话：021-20665952

传真：021-50783597

客户电话：4008219031

公司网址：www.lufunds.com

（50）民生证券有限责任公司

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

联系人：赵明

联系电话：010-85127622

传真：010-85127917

客户电话：400-619-8888

公司网址：www.msyzq.com

（51）中国民族证券有限责任公司

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40F-43F

法定代表人：何亚刚

联系人：齐冬妮

联系电话：010-59355807

客户电话：4008895618

公司网址：www.e5618.com

（52）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

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

（53）平安证券股份有限公司

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：曹实凡

联系人：周一涵

联系电话：021-38637436

传真：0755-82435367

客户电话：95511-8

公司网址：www.stock.pingan.com

（54）山西证券股份有限公司

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

法定代表人：侯巍

联系人：韩笑

联系电话：0351-8686656

传真：0351-8686619

客户电话：95573

公司网址：www.i618.com.cn

（55）上海证券有限责任公司

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：李俊杰

联系人：邵珍珍

联系电话：021-53686262

传真：021-53686100，021-53686200

客户电话：4008918918、021-962518

公司网址：www.962518.com

（56）申万宏源证券有限公司

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 40 楼

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

联系电话：021-33388211

传真：021-33388224

客户电话：95523、4008895523

公司网址：www.swhysc.com

（57）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

联系人：韩爱彬

联系电话：021-60897840

传真：0571-26697013

客户电话：4000-776-123

公司网址：<http://www.fund123.cn/>

（58）深圳腾元基金销售有限公司

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

联系人：鄢萌莎

联系电话：0755-33376922

客户电话：4006-877-899

公司网址：www.tenyuanfund.com

（59）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

联系人：杨蕾

联系电话：021-54509998

传真：021-64385308

客户电话：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.c

（60）浙江同花顺基金销售有限公司

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：0571-88911818

传真：0571-86800423

客户电话：4008-773-772

公司网址：www.5ifund.com

（61）上海万得投资顾问有限公司

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：021-51327185

传真：021-68882281

客户电话：400-821-0203

（62）北京新浪仓石基金销售有限公司

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

（63）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

法定代表人：张志刚

联系人：尹旭航

联系电话：010-63081493

客户电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

（64）兴业证券股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦

法定代表人：兰荣

联系人：乔琳雪、吴嘉虹

联系电话：021-38565547、021-38565570

客户电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

（65）宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

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：010-52855713

传真：010-85894285

客户电话：400-6099-200

公司网址：www.yixinfund.com

（66）中国银河证券股份有限公司

办公地址：中国北京西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈共炎

联系人：辛国政；邓颜

联系电话：010-83574507；010-66568292

传真：010-66568990

客户电话：95551、400-8888-888

公司网址：www.chinastock.com.cn

（67）招商证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 3945 层

法定代表人：宫少林

联系人：黄婵君

联系电话：86-755-82960167

客户电话：4008895565 或 95565

公司网址：www.newone.com.cn

（68）中经北证（北京）资产管理有限公司

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：010-68292745

传真：010-68292941

客户电话：400-600-0030

公司网址：www.bzfunds.com

（69）中泰证券股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 18 层

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

联系电话：021-20315290

客户电话：95538

公司网址：www.zts.com.cn

（70）中国中投证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层

01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

法定代表人：高涛

联系人：张鹏

联系电话：0755-82023442

客户电话：95532 或 4006008008

公司网址：www.china-invs.cn

（71）中信建投证券股份有限公司

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：许梦园

联系电话：010-85156398

客户电话：400-8888-108、95587

公司网址：www.csc108.com

（72）中信期货有限公司

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

（73）中信证券股份有限公司

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：马静懿

联系电话：010-60833889

传真：010-60836029

客户电话：95548

公司网址：www.cs.ecitic.com

（74）中信证券（山东）有限责任公司

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

（75）中银国际证券有限责任公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 31 楼

法定代表人：宁敏

联系人：许慧琳

联系电话：021-20328531

传真：021-50372474

客户电话：400-620-8888

公司网址：www.bocichina.com

（76）深圳众禄金融控股股份有限公司

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：0755-33227950

传真：0755-33227951

客户电话：400-678-8887

公司网址：www.zlfund.cn

（77）珠海盈米财富管理有限公司

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: 华宝基金管理有限公司(同上)

(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: (8621)31358666

传真: (8621)31358600

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

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: 华宝兴业先进成长混合型证券投资基金

基金类型: 契约型开放式基金

六、基金的投资

(一) 本基金投资目标、理念、范围、策略、业绩比较基准和风险收益特征

1、投资目标

分享我国经济增长方式转变过程中和转变完成后的先进企业的成长,在控制风险的前提下为基金份额持有人谋求长期超额的回报。

2、投资理念

先进引领成长,创造超额回报。

3、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、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的其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

4、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,通过公司自行开发的数量化辅助模型,结合宏观策略研究,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。本基金股票投资比例为 60%-95%,其中投资于先进企业股票占非现金资产的比例不低于 80%,权证投资比例为 0%-3%,债券及现金投资比例为 5%-40%(其中,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于 5%)。先进企业是指具备创新能力强、注重资源节约与环境友好、充分发挥人力资源优势这三个先进因素之一的企业。

(2) 股票投资策略

本基金认为,公司未来盈利的增长是股价上涨的主要驱动因素,在中国经济长期高速增长的背景下,创新能力强、注重资源节约和环境保护、充分发挥人力资源优势的先进企业具有更大的发展空间,投资于先进企业可以获取长期超额回报。因此将对上市

公司基本面的深入研究和长期前景的关注作为基金的投资基础。

1) 本基金首先将在公司三级股票库的基础上选用 7 个定量指标来筛选出排名靠前、成长潜力较大的上市公司作为本基金的备选库。这 7 个定量指标分别为:

a.成长指标: 过去三年平均主营业务收入增长率、过去三年平均息税折旧前利润 (EBITA) 增长率、未来一年预测每股收益 (EPS) 增长率、未来第二年预测每股收益 (EPS) 增长率;

b.价值指标: 预测动态市盈率;

c.盈利指标: 过去三年平均净资产收益率 (ROE)、过去三年平均投资回报率 (ROIC)。

2) 然后, 本基金将对有成长潜力的上市公司进行进一步案头研究和实地调研, 深入研究企业的基本面, 精选符合本基金先进性判断的上市公司。

a.企业先进性判断

创新能力: 重点关注具有先进的设备和技术、较好的品牌、创新的盈利模式和管理制度的企业。具体的指标包括研发 (R&D) 经费支出、研发 (R&D) 经费投入强度、专利申请数、发明专利量比重、新产品产值率、信息化程度等;

资源节约和环境保护能力: 重点关注资源节约和环境友好的企业、开发生产新能源新材料的企业、开发生产资源节约和环境保护相关产品的企业。具体的指标包括废水排放量、废气排放量、固体废弃物排放量、资源消耗率、单位产值废水排放率、单位产值废气排放率等;

人力资源利用能力: 重点关注技术密集型企业, 兼顾劳动密集型企业。具体的指标包括研发、技术人员数量和占比、员工培训支出、知识水平程度、业务熟练水平等。

b.企业基本因素判断: 规模、产能、管理、竞争优势等。

3) 行业配置策略

重点关注国家产业结构调整中鼓励类行业, 同时也兼顾有先进企业的传统行业。

最后优选成长性高、有持续成长能力且估值合理的先进企业作为本基金最终的投资组合, 并进行定期调整。

(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, 以实现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。

5、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准是新上证综指收益率。

新上证综指是我国证券市场由权威机构发布的反映股权分置改革实施后公司概况的指数, 当前由沪市所有 G 股组成, 此后实施股权分置改革的股票将在方案实施后的第二个交易日纳入指数。指数以总股本加权计算。随着股权分置改革的全面推进, 将有新的样本股加入新上证综指; 在不远的将来, 随着市场大部分上市公司完成股改, 新上证综指将逐渐成为主导市场的核心指数。

当市场出现更合适、更权威的比较基准时, 本基金管理人有权选用新的比较基准, 并将及时公告。

6、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、量化投资部负责跟踪数量分析模型

量化投资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和业绩贡献，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、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。

(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证券，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总和，其市值不超过该证券的 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%，债券及现金占 5%—40%（其中现金或者到期日在一年内的政府债券占 5%以上）；

（6）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过基金总资产，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；

（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）本基金资产总值不超过本基金资产净值的 140%；

（9）法律法规或中国证监会对上述比例限制另有规定的，应从其规定。

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(1)(5)项规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

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。

(六)基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至 2017 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 1,022,432,738.27 86.15

其中:股票 1,022,432,738.27 86.15

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 93,623,017.90 7.89

8 其他资产 70,684,614.71 5.96

9 合计 1,186,740,370.88 100.00

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 --

B 采矿业 36,145,400.00 3.09

C 制造业 706,850,863.18 60.38

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 --

E 建筑业 19,236,000.00 1.64

F 批发和零售业 4,345,509.04 0.37

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 72,326,952.32 6.18

J 金融业 139,425,149.32 11.91

K 房地产业 9,887,446.00 0.84

L 租赁和商务服务业 1,296,514.88 0.11

M 科学研究和技术服务业 --

N 水利、环境和公共设施管理业 17,222,000.00 1.47

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 15,696,903.53 1.34

S 综合 --

合计 1,022,432,738.27 87.33

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末未持有港股通投资股票。

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	300409	道氏技术	850,300	45,150,930.00	3.86
2	601717	郑煤机	4,500,000	34,875,000.00	2.98
3	600197	伊力特	1,500,000	34,500,000.00	2.95
4	300241	瑞丰光电	2,380,000	32,844,000.00	2.81
5	000546	金圆股份	2,350,000	32,806,000.00	2.80
6	601398	工商银行	5,000,000	30,000,000.00	2.56
7	600779	水井坊	699,990	29,273,581.80	2.50
8	002635	安洁科技	705,150	28,671,399.00	2.45
9	002777	久远银海	743,728	27,361,753.12	2.34
10	002460	赣锋锂业	303,700	26,513,010.00	2.26

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。

7、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。

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) 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 562,075.69

2 应收证券清算款 70,141,542.28

3 应收股利 -

4 应收利息 -157,809.44

5 应收申购款 138,806.18

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 70,684,614.71

(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 601717 郑煤机 34,875,000.00 2.98 重大事项停牌

七、基金的业绩

本基金业绩数据为截止 2017 年 9 月 30 日的的数据，本报告中所列数据未经审计。

(一) 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

净值增长率标准差

业绩比较基准收益率

业绩比较基准收益率标准差

— —

2006/11/07-2006/12/31 19.47% 0.82% 43.59% 1.58% -24.12% -0.76%

2007/01/01-2007/12/31 139.51% 1.79% 94.64% 2.22% 44.87% -0.43%

2008/01/01-2008/12/31 -51.21% 2.53% -65.42% 2.85% 14.21% -0.32%

2009/01/01-2009/12/31 80.68% 1.69% 79.57% 1.90% 1.11% -0.21%

2010/01/01-2010/12/31 -14.51% 1.46% -14.58% 1.42% 0.07% 0.04%

2011/01/01-2011/12/31 -31.35% 1.24% -21.53% 1.15% -9.82% 0.09%
2012/01/01-2012/12/31 6.24% 1.19% 3.17% 1.09% 3.07% 0.10%
2013/01/01-2013/12/31 38.94% 1.46% -6.99% 1.16% 45.93% 0.30%
2014/01/01-2014/12/31 13.63% 1.36% 53.05% 1.09% -39.42% 0.27%
2015/01/01-2015/12/31 91.45% 2.86% 9.29% 2.45% 82.16% 0.41%
2016/01/01-2016/12/31 -26.34% 1.80% -12.30% 1.45% -14.04% 0.35%
2017/01/01-2017/09/30 2.77% 0.78% 7.93% 0.54% -5.16% 0.24%
2006/11/07-2017/09/30 259.93% 1.76% 76.75% 1.74% 183.18% 0.02%

（二）自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较

累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2006 年 11 月 7 日至 2017 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 2007 年 5 月 7 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

八、基金份额的申购和赎回

（一）申购与赎回的场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。具体销售网点将由基金管理人在基金份额发售公告或其他公告中列明。基金管理人可以根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。

投资人可以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的申购与赎回。具体办法另行公告。

（二）申购与赎回办理的开放日及时间

1、开放日及开放时间

上海证券交易所和深圳证券交易所同时开放交易的工作日为本基金的开放日。具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

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并公告。

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。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

2、申购与赎回的开始时间

本基金自 2006 年 12 月 11 日起开始办理日常申购业务。

本基金自 2007 年 1 月 4 日起开始办理日常赎回业务。

（三）申购与赎回的原则

1、未知价原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人在销售机构托管的基金份额进行赎回处理时，申购确认日期在先的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

4、当日的申购与赎回申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销；

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前 3 个工作日予以公告。

（四）申购与赎回的程序

1、申购与赎回申请的提出

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立。

登记机构确认基金份额的，申购生效。申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成立，申购款项将退回投资者账户。

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，基金管理人应通过登记机构按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过 7 个工作日内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金合同和有关法律法规规定处理。

2、申购与赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前收到申购和赎回申请的当日作为申购或赎回申请日(T 日)，并在 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，投资人可在 T+2 日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。

3、申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成交后，基金管理人应通过注册登记机构按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过 7 个工作日内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金合同和有关法律法规规定处理。

（五）申购与赎回的数额限制

1、申请申购基金的金额

通过代销网点和直销 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 100 元人民币（含申购费）。已有认购本基金记录的投资人不受首次申购最低金额的限制，但受追加申购最低金额的限制。

代销网点的投资人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。

投资人可多次申购，对单个投资人累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

2、申请赎回基金的份额

投资人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。基金持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）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。

基金管理人可根据市场情况调整上述申购与赎回的规定，但应最迟在调整生效前三个工作日在至少一种指定媒体予以公告并报中国证监会备案。

（六）基金的申购费和赎回费

1、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。

2、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—三年（含三年） 0.3%

三年以上 0%

本基金的赎回费用由赎回人承担，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。

（七）申购份额与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算方式

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。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

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，赎回净额为赎回金额扣除相应的费用的金额，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、T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金份额总额。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

4、本基金份额净值的计算，保留到小数点后四位，小数点后第五位四舍五入，由此产生的误差在基金财产中列支。

5、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，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前3个工作日在至少一种指定媒体公告。

九、基金的费用

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：

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

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：

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

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,但应报中国证监会批准。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。

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,华宝基金管理有限公司对《华宝兴业先进成长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、九、与基金管理人管理的其他基金转换更新了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。

5、十、基金的投资更新了截至 2017 年 9 月 30 日的基金的投资组合报告。

6、十一、基金的业绩更新了截至 2017 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更新了对基金份额持有人服务的相关信息。

8、二十四、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。

华宝基金管理有限公司

2017 年 12 月 21 日