华宝兴业可转债债券型证券投资基金
招募说明书（更新）

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：招商银行股份有限公司

【重要提示】

本基金根据中国证券监督管理委员会证监许可［2011］130 号的核准，进行募集。

基金管理人保证《华宝兴业可转债债券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。

本基金以可转债为主要投资对象，该类债券的流动性较差，可能会影响基金构建投资组合和及时实现资产变现。本基金可能对部分看好的可转债进行集中投资和长期持有，因流动性、交易价格波动等原因，基金净值可能发生短期波动。可转债正股价格的波动可能会影响可转债的内在价值，从而影响其市场价格，导致收益的不确定性。另外，作为债券基金的持有人，投资者还要承担债券发行人出现违约引起的信用风险等等。

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。

本招募说明书根据 2014 年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》进行了部分更新。本招募说明书所载内容截止日为 2016 年 4 月 27 日，有关财务数据和净值表现数据截止日为 2016 年 3 月 31 日，财务数据未经审计。

投资有风险，投资人申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

目　　录

一、 绪　言.....1
二、 释　义.....2
三、 基金管理人.....6
四、 基金托管人.....12
五、 相关服务机构.....17
六、 基金的募集.....34
七、 基金合同生效.....35
八、 基金份额的申购与赎回.....36
九、与基金管理人管理的其他基金转换.....43
十、 基金的投资.....54
十一、基金的业绩.....63
十二、基金财产.....65
十三、基金资产估值.....66
十四、基金收益与分配.....71
十五、基金的费用.....72
十六、基金的会计与审计.....74
十七、基金的信息披露.....75
十八、风险揭示.....79
十九、基金合同的变更、终止与基金财产清算.....81
二十、基金合同的内容摘要.....84
二十一、基金托管协议内容摘要.....96
二十二、对基金份额持有人的服务.....105
二十三、其他应披露事项.....108
二十四、招募说明书存放及查阅方式.....109
二十五、备查文件.....110

一、 绪 言

本招募说明书依据《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》”)、其他有关规定及《华宝兴业可转债债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

本招募说明书阐述了华宝兴业可转债债券型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的必要事项，投资人在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金是根据本招募说明书所载明资料申请募集的。本招募说明书由本基金管理人解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作出任何解释或者说明。

本招募说明书根据基金合同编写，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。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，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》、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。

二、 释 义

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1.基金或本基金：指华宝兴业可转债债券型证券投资基金

2.基金管理人：指华宝兴业基金管理有限公司

3.基金托管人：指招商银行股份有限公司

4.基金合同：指《华宝兴业可转债债券型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5.托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《华宝兴业可转债债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6.招募说明书或本招募说明书：指《华宝兴业可转债债券型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

7.基金份额发售公告：指《华宝兴业可转债债券型证券投资基金份额发售公告》

8.法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

9.《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

10.《销售办法》：指中国证监会 2011 年 6 月 9 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

11.《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12.《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13.中国证监会：指中国证券监督管理委员会

14.银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

15.基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

16.个人投资者：指年满 18 周岁，合法持有现时有效的中华人民共和国居民身份证、军人证件等有效身份证件的中国公民，以及依据有关法律法规规定或中国证监会批准可投资于证券投资基金的其他自然人

17.机构投资者：指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

18.合格境外机构投资者：指符合现时有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

19.投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

20.基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

21.基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

22.销售机构：指直销机构和代销机构

23.直销机构：指华宝兴业基金管理有限公司

24.代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

25.基金销售网点：指直销机构的直销柜台及代销机构的代销网点

26.基金网上交易系统：指直销机构的直销 e 网金及代销机构的网上交易系统

27.注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等

28.注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为华宝兴业基金管理有限公司或接受华宝兴业基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构

29.基金账户：指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

30.基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户

31.基金合同生效日：指 2011 年 4 月 27 日

32.基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

33.基金募集期：指基金合同和招募说明书中载明的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月

34.存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

35.工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

36.T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日

37.T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

38.开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

39.交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

40.《业务规则》：指《华宝兴业基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是由基金管理人制订并由其解释、修改的规范基金管理人所管理的证券投资基金登记结算方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

41.认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为

42.申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

43.赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

44.基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为

45.转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

46.定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

47.巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请(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)超过上一开放日基金总份额的 10%

48.元：指人民币元

49.基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

50.基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

51.基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

52.基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数所得的基金单位份额的价值

53.基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

54.指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

55.不可抗力：指基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使基金合同当事人无法全部或部分履行基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易、公众通讯设备或互联网络故障。

三、 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：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

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 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股票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

王瑞海先生，曾在深圳中大投资管理公司、海南证券北京营业部、太平人寿保险有限公司、太平资产管理有限公司从事投资管理、股票自营和固定收益投资研究工作。2012 年 7 月加入华宝兴业基金管理有限公司，曾任固定收益部总经理，2013 年 4 月 2014 年 10 月兼任华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理，2014 年 5 月起兼任华宝兴业可转债债券型证券投资基金基金经理，2014 年 2 月至 2014 年 5 月兼任华宝兴业中证短融 50 指数债券型证券投资基金基金经理，2014 年 5 月至 2015 年 11 月兼任华宝兴业活期通货币市场基金基金经理。

5．固定收益投资决策委员会成员

任志强先生，副总经理、投资总监。

陈昕先生，固定收益部副总经理、华宝兴业现金宝货币市场基金、华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金经理。

王瑞海先生，华宝兴业可转债债券型证券投资基金基金经理。

李栋梁先生，华宝兴业宝康债券投资基金、华宝兴业增强收益债券型证券投资基金、华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝兴业宝鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。。

（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》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，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。

四、 基金托管人

（一）基金托管人概况

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987 年 4 月 8 日

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

注册资本：252.20 亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83 号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于 1987 年 4 月 8 日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于 2002 年 3 月成功地发行了 15 亿 A 股，4 月 9 日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006 年 9 月又成功发行了 22 亿 H 股，9 月 22 日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10 月 5 日行使 H 股超额配售，共发行了 24.2 亿 H 股。截止,2015 年 12 月 31 日，本集团总资产 5.475 万亿元人民币，高级法下资本充足率 12.57%，权重法下资本充足率 11.91%。

2002 年 8 月，招商银行成立基金托管部；2005 年 8 月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室 5 个职能处室，现有员工 60 人。2002 年 11 月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003 年 4 月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价

值，独创“6S 托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6 心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利 ETF 基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

经过十四年发展，招商银行资产托管规模快速壮大。2016 年招商银行加大高收益托管产品营销力度，截止 3 月末新增托管公募开放式基金 12 只，新增首发公募开放式基金托管规模 114.94 亿元。克服国内证券市场震荡的不利形势，托管费收入、托管资产均创出历史新高，实现托管费收入 11.835 亿元，同比增长 6.789%，托管资产余额 7.596 万亿元，同比增长 104.08%。作为公益慈善基金的首个独立第三方托管人，成功签约“壹基金”公益资金托管，为我国公益慈善资金监管、信息披露进行有益探索，该项目荣获 2012 中国金融品牌「金象奖」“十大公益项目”奖；四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。

（二）主要人员情况

李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014 年 7 月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013 年 5 月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于 2003 年 7 月至 2013 年 5 月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

丁伟先生，本行副行长。大学本科毕业，副研究员。1996 年 12 月加入本行，历任杭州分行办公室主任兼营业部总经理，杭州分行行长助理、副行长，南昌支行行长，南昌分行行长，总行人力资源部总经理，总行行长助理，2008 年 4 月起任本行副行长。兼任招银国际金融有限公司董事长。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002 年 9 月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有 20 余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

（三）基金托管业务经营情况

截至 2016 年 3 月 31 日，招商银行股份有限公司累计托管 163 只开放式基金及其它托管资产，托管资产为 7.596 万亿元人民币。

（四）托管人的内部控制制度

1、 内部控制目标

确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全完整；建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

2、 内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系：

一级风险防范是在总行层面对风险进行预防和控制。

二级防范是总行资产托管部设立稽核监察室，负责部门内部风险预防和控制。稽核监察室在总经理室直接领导下，独立于部门内其他业务室和托管分部、分行资产托管业务主管部门，对各岗位、各业务室、各分部、各项业务中的风险控制情况实施监督，及时发现内部控制缺陷，提出整改方案，跟踪整改情况。

三级风险防范是总行资产托管部在专业岗位设置时，必须遵循内控制衡原则，监督制衡的形式和方式视业务的风险程度决定。

3、 内部控制原则

（1）全面性原则。内部控制应覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有室和岗位，并由全部人员参与。

（2）审慎性原则。内部控制的核心是有效防范各种风险，托管组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点，应当体现“内控优先”的要求。

（3）独立性原则。各室、各岗位职责应当保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间应当分离。内部控制的检查、评价部门应当独立于内部控制的建立和执行部门，稽核监察室应保持高度的独立性和权威性，负责对部门内部控制工作进行评价和检查。

（4）有效性原则。内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权利，内部控制存在的问题应当能够得到及时的反馈和纠正。

（5）适应性原则。内部控制应适应我行托管业务风险管理的需要，并能随着托管业务经营战略、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修订和完善。内部控制应随着托管业务经营战略、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订和完善。

（6）防火墙原则。业务营运、稽核监察等相关室，应当在制度上和人员上适当分离，办公网和业务网分离，部门业务网和全行业务网分离，以达到风险防范的目的。

（7)重要性原则。内部控制应当在全面控制的基础上,关注重要托管业务事项和高风险领域。

（8）制衡性原则。内部控制应当在托管组织体系、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。

（9）成本效益原则。内部控制应当权衡托管业务的实施成本与预期效益，以适当的成本实现有效控制。

4、 内部控制措施

（1）完善的制度建设。招商银行资产托管部制定了《招商银行证券投资基金托管业务管理办法》、《招商银行资产托管业务内控管理办法》、《招商银行基金托管业务操作规程》和等一系列规章制度，从资产托管业务操作流程、会计核算、岗位管理、档案管理、保密管理和信息管理等方面，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。为保障托管资产安全和托管业务正常运作，切实维护托管业务各当事人的利益，避免托管业务危机事件发生或确保危机事件发生后能够及时、准确、有效地处理，招商银行还制定了《招商银行托管业务危机事件应急处理办法》，并建立了灾难备份中心，各种业务数据能及时在灾难备份中心进行备份，确保灾难发生时，托管业务能迅速恢复和不间断运行。

（2）经营风险控制。招商银行资产托管部托管项目审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理、差错处理等一系列完整的操作规程，有效地控制业务运作过程中的风险。

（3）业务信息风险控制。招商银行资产托管部采用加密方式传输数据。数据执行异地同步灾备，同时，每日实时对托管业务数据库进行备份，托管业务数据每日进行备份，所有的业务信息须经过严格的授权才能进行访问。

（4）客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中形成的客户资料，视同会计资料保管。客户资料不得泄露，有关人员如需调用，须经总经理室成员审批，并做好调用登记。

（5）信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房 24 小时值班并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护等，保证信息技术系统的安全。

（6）人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯级队伍及人才储备机制，有效的进行人力资源控制。

（五）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

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》等有关证券法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金管理人参与银行间债券市场、基金管理人选择存款银行、基金资产净值计算、基金份额净值计算、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人对上述事项的监督与核查中发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述监督内容的约定和其他有关法律法规的规定，应及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法规允许的投资比例调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定时间内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人限期改正，如基金管理人未能在通知期限内纠正的，基金托管人应向中国证监会报告。

基金管理人有义务配合和协助基金托管人依照法律法规基金合同和托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期

纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

五、 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。

住所：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

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 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

（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）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

（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

（4）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

（5）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

（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）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

（11）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

（12）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：955414

（13）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

（14）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

（15）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

（16）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：010-66568450

联系人：宋明

公司网址：www.chinastock.com.cn

（17）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

（18）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

（19）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

（20）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

（21）东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦

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

(22) 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

(23)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

（24）平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层；

办公地址：深圳市福田中心区金田路 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： 021-386374362

公司网址: http://www. stock.pingan.com

（25）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

（26）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

（27）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

（28）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

（29）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

（30）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

（31）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

（32）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

（33）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：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

（34）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：杜庆平

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

（35）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：刘毅

客服电话： 95532

网址：www.china-invs.cn

（36）国元证券股份有限公司

注册地址：合肥寿春路 179 号

法人代表：凤良志

客户服务热线：4008888777 或 95578

公司网址：www.gyzq.com.cn

（37）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

（38）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：丁学东

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

(39)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.mszq.com

客户服务电话：4006198888

（40）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

（41）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

（42）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

（43）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

（44）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

（45）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：杨树财

电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

客服电话：4006000686

网址：www.nesc.cn

（46）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

邮政编码：200122

注册资本：16.9 亿元人民币

法定代表人：姚文平

联系人：朱磊

联系电话：862168761616-8507

传真：862168767981

（47）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（安徽）、400-80-96518（全国）

（48）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：上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：龚德雄

联系人：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

（49）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

（50）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

（51）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

（52）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

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

（53）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

（54）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

(55)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

（56）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：021-20613600

传真：021-68596919

客服热线：400-700-9665

好买基金交易网：www.ehowbuy.com

(57)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

(58)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

(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)杭州数米基金销售有限公司

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： 0571-26697013

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

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

邮政编码： 200127

注册资本：人民币伍仟万元

法定代表人： 其实

电 话： 021-54509998

传 真： 021-64385308

公司网址：www.1234567.com.cn

客户服务电话：400-1818-188

(62)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

（63）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

（64）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

（65）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

客户服务电话： 4008219031

（66）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

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

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 58 楼

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 58 楼

电话：021－38505888

传真：021－38505777

联系人：章希

(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：俞卫锋

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

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：张勇

经办注册会计师：薛竞、张勇

六、 基金的募集

本基金经中国证监会证监基金字［2011］130 号《关于同意华宝兴业可转债债券型证券投资基金募集的批复》核准，由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集，募集期从 2011 年 3 月 28 日起，至 2011 年 4 月 22 日止，共募集 1,448,383,785.88 份基金份额，有效认购户数为 6091 户。

七、 基金合同生效

基金合同于 2011 年 4 月 27 日生效。本基金基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

八、 基金份额的申购与赎回

（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。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。基金管理人可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。

（二）申购与赎回办理的开放日及时间

1.开放日及开放时间

投资人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。开放日的具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

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体上公告。

2.申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金自 2011 年 7 月 4 日起开始办理日常申购、赎回业务。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体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.“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.赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

4.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。

基金管理人可根据基金运作的实际情况依法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体上公告。

（四）申购与赎回的程序

1.申购和赎回的申请方式

投资人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。

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

2.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，本基金注册登记机构在 T+1 日内对该申请的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人可在 T+2 日后(包括该日)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。基金销售机构对申购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。申购的确认以注册登记机构的确认结果为准。

3.申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项本金退还给投资人。

投资人 T 日提出的赎回申请被确认有效后，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。

（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，合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人进行前述调整必须提前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登公告。

（六）申购费与赎回费

1．申购费

本基金采用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	0.2%
大于等于 100 万，小于 200 万	0.4%
大于等于 50 万，小于 100 万	0.6%
50 万以下	0.8%

申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2．赎回费

本基金的最高赎回费率不超过 5%，赎回费随基金持有时间的增加而递减。本基金的赎回费率表如下：

持有时间	赎回费率
两年以内	0.5%
两年以上（含两年）	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。不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

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，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）申购份额与赎回金额的计算方式

1．申购份额的计算方式

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

申购份额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分舍去，由此产生的误差计入基金财产。其他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 T 日投资 40,000 元人民币申购本基金的基金份额，其对应的申购费率为 0.8%，T 日本基金份额净值为 1.0695 元人民币，则其可得到的基金份额计算如下：

净申购金额＝40,000/(1+0.8%)＝39,682.54 元

申购费用＝40,000－39,682.54＝317.46 元

申购份额＝39,682.54/1.0695＝37,103.82 份

即投资者投资 40,000 元人民币申购本基金，可得到 37,103.82 份基金份额。

2．赎回金额的计算方式

赎回总额=赎回份额×赎回当日基金份额净值

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

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。

例：某投资者 T 日赎回其持有的本基金 2000 份基金份额，T 日本基金份额净值为 1.0917 元人民币，持有时间为一年三个月，对应的赎回费率为 0.5%，则其可得到的净赎回金额计算如下：

赎回总金额＝2000×1.0917＝2183.4 元

赎回费用＝2183.4×0.5%＝10.92 元

净赎回金额＝2183.4－10.92＝2172.48 元

即投资者赎回其持有的本基金 2000 份基金份额，可得到净赎回金额 2172.48 元。

3．本基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 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）申购与赎回的注册登记

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，基金注册登记机构在 T＋1 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，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，基金注册登记机构在 T＋1 日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

4．基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日予以公告。

（九）拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1．因不可抗力导致基金无法正常运作。

2．证券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。

3．发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

4．基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或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，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

6．法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。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）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1．因不可抗力导致基金无法正常运作。

2．证券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。

3．连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

4．发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

5．法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已接受的赎回申请，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已被接受的赎回申请量占已接受赎回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，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，延期支付最长不得超过 20 个工作日，并在指定媒体上公告。投资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予以公告。

（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人的全部赎回申请时，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人的赎回申请有困难或认为因支付投资人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，投资人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。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3)暂停赎回：连续 2 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，并应当在指定媒体上进行公告。

3．巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，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 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒体上刊登公告。

（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，并在规定期限内在指定媒体上刊登暂停公告。

2．如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

3．如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

4．如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

(十三)基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、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人。

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注册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注册登记机构的规定办理，受理非交易过户申请的销售机构可按规定标准收取过户费用。

基金注册登记机构受理司法强制执行情况下的非交易过户，其他销售机构不得办理该情况下的非交易过户业务。

(十四)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。

(十五)基金的冻结和解冻

基金注册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，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金账户或是基金份额被冻结的，对冻结部分产生的权益一并冻结。

九、与基金管理人管理的其他基金转换

（一）基金转换申请人的范围

本基金的持有人均可以按照基金合同的规定申请和办理本基金与基金管理人管理的其他基金的转换。

（二）基金转换受理场所

本公司直销柜台、直销 e 网金、招商银行、中国建设银行、中国银行、交通银行、中国民生银行、中信银行、平安银行、上海浦东发展银行、兴业银行、江苏银行、渤海银行、国泰君安证券、光大证券、海通证券、中国银河证券、中信建投证券、招商证券、广发证券、长江证券、东吴证券、申万宏源证券、平安证券、中信证券、东方证券、兴业证券、国信证券、华泰证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、中投证券、安信证券、中国国际金融公司、华宝证券、中泰证券、华福证券、信达证券、江海证券、国都证券、东北证券、德邦证券、华安证券、上海证券、东海证券、众禄金融控股股份有限公司、上海好买基金销售公司、杭州数米基金销售公司、上海天天基金销售公司、和讯信息科技有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问公司、新兰德证券投资咨询公司、浙江同花顺基金销售公司、深圳腾元基金销售有限公司、中经北证（北京）资产管理有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司受理本基金与本公司管理的宝康系列基金（宝康消费品基金、宝康灵活配置基金、宝康债券基金）、现金宝货币市场基金（A/B 类）、多策略增长基金之间的转换业务。

本公司直销柜台、直销 e 网金、招商银行、中国建设银行、中国银行、中国工商银行、交通银行、中国民生银行、中信银行、平安银行、上海浦东发展银行、兴业银行、江苏银行、渤海银行、国泰君安证券、光大证券、海通证券、中国银河证券、中信建投证券、招商证券、广发证券、长江证券、东吴证券、申万宏源证券、平安证券、中信证券、东方证券、兴业证券、国信证券、华泰证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、中投证券、安信证券、中国国际金融公司、华宝证券、中泰证券、华福证券、信达证券、江海证券、国都证券、东北证券、德邦证券、华安证券、上海证券、东海证券、众禄金融控股股份有限公司、上海好买基金销售公司、杭州数米基金销售公司、上海天天基金销售公司、和讯信息科技有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问公司、新兰德证券投资咨询公司、浙江同花顺基金销售公司、深圳腾元基金销售有限公司、中经北证（北京）资产管理有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司受理本基金与本公司管理的动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、大盘精选基金、增强收益债券基金（A/B 类）、中证 100 指数基金（前端收费模式）、上证 180 价值 ETF 联接基金、新兴产业基

金之间的转换业务。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国银行、中国建设银行、中国工商银行、交通银行、招商银行、上海浦东发展银行、中国民生银行、渤海银行、中信银行、国泰君安证券、申万宏源证券、海通证券、光大证券、中信建投证券、广发证券、中信证券、长江证券、华福证券、国信证券、中国银河证券、中泰证券、华宝证券、上海证券、招商证券、信达证券、国都证券、华安证券、德邦证券、渤海证券、兴业证券、东海证券、江海证券、恒泰证券、国元证券、东吴证券、长城证券、华泰证券、中投证券、平安证券、东北证券、中航证券、安信证券、中银国际证券、中国国际金融公司、众禄金融控股股份有限公司、上海好买基金销售公司、杭州数米基金销售公司、上海天天基金销售公司、和讯信息科技有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问公司、新兰德证券投资咨询公司、浙江同花顺基金销售公司、深圳腾元基金销售有限公司、中经北证（北京）资产管理有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司已开通本基金与上证 180 成长 ETF 联接基金的转换业务。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国建设银行、中国银行、中国工商银行、交通银行、招商银行、中信银行、平安银行、渤海银行、中国民生银行、国泰君安证券、光大证券、海通证券、中国银河证券、广发证券、长江证券、东吴证券、申万宏源证券、平安证券、中信证券、东方证券、兴业证券、国信证券、中信万通证券、华泰证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、中投证券、华宝证券、中泰证券、信达证券、国都证券、德邦证券、上海证券、中航证券、招商证券、东北证券、华福证券、中信建投证券、江海证券、国元证券、华安证券、中银国际证券、民生证券、中国国际金融公司、东海证券、众禄金融控股股份有限公司、上海好买基金销售公司、杭州数米基金销售公司、上海天天基金销售公司、和讯信息科技有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问公司、新兰德证券投资咨询公司、浙江同花顺基金销售公司、深圳腾元基金销售有限公司、中经北证（北京）资产管理有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司已开通本基金与医药生物基金的转换业务。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国银行、中国建设银行、中国工商银行、交通银行、招商银行、中国民生银行、上海浦东发展银行、渤海银行、国泰君安证券、光大证券、海通证券、中国银河证券、中信建投证券、广发证券、长江证券、东吴证券、申万宏源证券、平安证券、东方证券、国信证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、中国中投证券、华宝证券、中泰证券、信达证券、江海证券、国都证券、德邦证券、华安证券、上海证券、东海证券、中航证券、民生证券、中国国际金融、兴业证券、中银国际证券、华福证券、东北证券、安信证券、众禄金融控股股份有限公司、上海好买基金销售公司、杭州数米基金销售公司、上海天天基金销售公司、和讯信息

科技有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问公司、新兰德证券投资咨询公司、浙江同花顺基金销售公司、深圳腾元基金销售有限公司、中经北证（北京）资产管理有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司已开通本基金与资源优选基金的转换业务。

本公司直销柜台、直销e网金、中国建设银行、中国银行、交通银行、招商银行、上海浦东发展银行、渤海银行、中国民生银行、国泰君安证券、光大证券、海通证券、中国银河证券、中信建投证券、长江证券、东吴证券、申万宏源证券、平安证券、中信证券、兴业证券、国信证券、中信万通证券、华泰证券、中银国际证券、长城证券、中国中投证券、华宝证券、中泰证券、信达证券、国都证券、东北证券、德邦证券、华安证券、东海证券、中航证券、山西证券、江海证券、上海证券、好买基金销售公司、众禄金融控股股份有限公司、数米基金销售公司、天天基金销售公司、和讯信息科技有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问公司、新兰德证券投资咨询公司、浙江同花顺基金销售公司、深圳腾元基金销售有限公司、中经北证（北京）资产管理有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司已开通本基金与服务优选基金之间的转换业务。

本公司直销柜台、直销e网金、中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、渤海银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、申万宏源证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、华宝证券有限责任公司、长城证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中国国际金融股份有限公司、中泰证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、江海证券有限公司、国都证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、东海证券股份有限公司、中航证券有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、中经北证（北京）资产管理有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司已开通本基金与创新优选基金之间的转换业务。

本公司直销柜台、直销e网金、中国建设银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、渤海银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、申万宏源证券股份有限公司、江海证券有限公司、中国银河证券股份有限公司、广发证券股份有

限公司、中国国际金融股份有限公司、国信证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、中航证券有限公司、长城证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、中泰证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、国都证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、中经北证（北京）资产管理有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司已开通本基金与生态中国基金之间的转换业务。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、渤海银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、平安证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、华宝证券有限责任公司、长城证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中国国际金融股份有限公司、中泰证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、江海证券有限公司、国都证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、东海证券股份有限公司、中航证券有限公司、山西证券股份有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、中经北证（北京）资产管理有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司已开通本基金与量化对冲基金之间的转换业务。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国建设银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、渤海银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、平安证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、华宝证券有限责任公司、长城证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中国国际金融股份有限公司、中泰证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、江海证券有限公司、国都证券股份有限公司、东北证券股

份有限公司、德邦证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、东海证券股份有限公司、中航证券有限公司、华福证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、和讯信息科技有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司、中经北证（北京）资产管理有限公司已开通本基金与高端制造基金之间的转换业务。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、渤海银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、长江证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、中国国际金融股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、中航证券有限公司、国都证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、江海证券有限公司、中国银河证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、和讯信息科技有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司已开通本基金与品质生活基金之间的转换业务。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、渤海银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、中信证券（山东）有限责任公司、华宝证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、中泰证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、江海证券有限公司、国都证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、华安证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、东海证券股份有限公司、中航证券有限公司、申万宏源证券有限公司、华福证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、和讯信息科技有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、上海好

买基金销售有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司、中经北证（北京）资产管理有限公司已开通本基金与稳健回报基金之间的转换业务。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国建设银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、渤海银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、华宝证券有限责任公司、中国国际金融股份有限公司、中泰证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、江海证券有限公司、国都证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、东海证券股份有限公司、中航证券有限公司、申万宏源证券有限公司、中国中投证券有限责任公司、和讯信息科技有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司、中经北证（北京）资产管理有限公司已开通本基金与事件驱动基金之间的转换业务。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、渤海银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、长城证券有限责任公司、中信证券（山东）有限责任公司、华宝证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、中泰证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、江海证券有限公司、国都证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、华安证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、中航证券有限公司、上海证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、和讯信息科技有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司、中经北证（北京）资产管理有限公司已开通本基金与国策导向基金之间的转换业务。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国银行股份有限公司、渤海银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公

司、中信建投证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、长城证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、华宝证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、中国国际金融股份有限公司、中泰证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、江海证券有限公司、国都证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、中航证券有限公司、东吴证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、和讯信息科技有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司、中经北证（北京）资产管理有限公司已开通本基金与新价值基金之间的转换业务。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国建设银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、渤海银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、长江证券股份有限公司、江海证券有限公司、平安证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、中航证券有限公司、国都证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、和讯信息科技有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司、中经北证（北京）资产管理有限公司、上海好买基金销售有限公司已开通本基金与万物互联基金之间的转换业务。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国建设银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、渤海银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、长江证券股份有限公司、江海证券有限公司、平安证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中国际金融股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、信达证券

股份有限公司、德邦证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、中航证券有限公司、国都证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、中信期货有限公司、东北证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、东兴证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、和讯信息科技有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司、中经北证（北京）资产管理有限公司、上海好买基金销售有限公司已开通本基金与转型升级基金之间的转换业务。

本公司直销柜台、直销 e 网金、中国建设银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、渤海银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、长江证券股份有限公司、江海证券有限公司、平安证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、中航证券有限公司、国都证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、中信期货有限公司、东北证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、东兴证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、和讯信息科技有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司、中经北证（北京）资产管理有限公司、上海好买基金销售有限公司已开通本基金与核心优势基金之间的转换业务。

基金转换只能在同一销售机构进行，转换的两只基金必须都是该销售机构代理销售的本公司管理的基金。

（三）基金转换受理时间

投资人可以在基金开放日的交易时间段申请办理基金转换业务，具体办理时间与基金申购、

赎回业务办理时间一致。

（四）基金转换费用

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。

（五）基金转换公式

1、基金转换公式为：

转出费用=转出份额*转出基金份额净值*转出基金赎回费率

转出总金额=转出份额*转出基金份额净值

净转出金额=转出总金额-转出费用

净转入金额=净转出金额/（1+补差费率）

(补差费率=转出基金申购费率与转入基金申购费率差)

转换补差费用=净转出金额-净转入金额

转入份额=净转入金额/转入基金份额净值

转入份额保留小数点后两位，小数点后两位以后的余额对应的部分计入基金财产。

2、基金管理人在不损害本基金份额持有人权益的情况下可更改上述公式，但应最迟在新的公式适用前 3 个工作日予以公告。

（六）不同基金之间的转换不影响投资者的持有基金时间的计算。

（七）基金转换的程序

1、基金转换的申请方式

基金份额持有人必须根据基金管理人和基金销售代理人规定的手续，在开放日的交易时间段内提出基金转换申请。

2、基金转换申请的确认

基金管理人以收到基金转换申请的当天作为基金转换申请日（T 日），并在 T+1 工作日对该交易的有效性进行确认。投资人可在 T+2 工作日及之后到其提出基金转换申请的网点进行成交查询。

基金份额持有人申请转换时，遵循"先进先出"的原则，即份额注册日期在前的先转换出，份额注册日期在后的后转换出，如果转换申请当日，同时有赎回申请的情况下，则遵循先赎回后转换的处理原则。

（八）基金转换的数额限制

基金转换遵循“份额转换”的原则，转换申请份额精确到小数点后两位。从本基金、宝康系列基金、多策略增长基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、大盘精选基金、增强收益债券基金、中证 100 指数基金（前端收费模式）、上证 180 价值 ETF 联接基金、新兴产业基金、上证 180 成长 ETF 联接基金、医药生物基金、资源优选基金、服务优选基金、创新优选基金、生态中国基金、量化对冲基金、高端制造基金、品质生活基金、稳健回报基金、事件驱动基金、国策导向基金、新价值基金、万物互联基金、转型升级基金、核心优势基金转出，单笔转换申请份额不得低于 100 份；从现金宝货币市场基金转出，单笔转换申请份额不得低于 100 份。因为转换等非赎回原因导致投资人在销售机构（网点）保留的基金份额余额少于该基金最低保留份额数量限制的，注册登记机构不作强制赎回处理。

（九）基金转换的注册登记

1、基金投资人提出的基金转换申请，在当日交易时间内可以撤销，交易时间结束后不得撤销。

2、基金注册登记机构在 T+1 日内对基金份额持有人基金转换申请进行确认，确认成功后为基金份额持有人办理相关的注册登记手续。

3、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日予以公告。

（十）拒绝或暂停基金转换的情形及处理方式

1、除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停接受基金份额持有人的基金转换申请：

（1） 不可抗力；

（2） 货币市场工具主要交易场所在交易时间非正常停市；

（3） 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔转换；

（4） 暂停估值；

（5） 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

如果基金份额持有人的基金转换申请被拒绝，基金份额持有人持有的原基金份额不变。

2、发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。

3、发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人有正当理由认为需要拒绝或暂停接受基金转换申请的，应当报中国证监会备案。

4、暂停基金转换，基金管理人应立即在至少一种指定媒体上公告。

5、暂停期结束，基金管理人应当公告最新的基金收益和转份额的情况。

如果发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日在至少一种指定信息披露媒体上刊登基金重新开放基金转换的公告，并公告最新的基金收益情况。

如果发生暂停的时间超过 1 日但少于两周，暂停结束，重新开放基金转换时，基金管理人应提前 1 个工作日在至少一种指定媒体刊登基金重新开放基金转换的公告，并在重新开放基金转换日公告最新的基金收益情况。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，重新开放基金转换时，基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种指定媒体上连续刊登基金重新开放基金转换的公告，并在重新开放基金转换日公告最新的基金收益的情况。

十、 基金的投资

(一)投资目标

在控制风险和保持资产流动性的前提下，主要通过对可转债的投资，力争为基金份额持有人创造稳定的当期收益和长期回报。

(二)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 A 股股票（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、货币市场工具、权证、资产支持证券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。

本基金所投资的固定收益类资产包括：国债、央行票据、金融债、公司债、企业债、可转债（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、银行存款、债券回购等。本基金投资于上述固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于可转债（含分离交易可转债）的比例不低于固定收益类资产的 80%。

本基金不可直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与一级市场新股申购或增发新股，并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资分离交易可转债而产生的权证等。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金应在其可交易（即不受锁定期等任何交易限制）之日起的三个月内卖出。该部分权益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%。

本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券合计不低于基金资产净值的 5%。

(三)投资策略

1．资产配置策略

本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于可转债（含分离交易可转债）的比例不低于固定收益类资产的 80%，投资于权益类资产的比例不高于基金资产的 20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

本基金采用自上而下的宏观投资策略，通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求情况，以及证券市场走势、信用风险情况、风险预算和有关法律法规等因素的综合分析，深度剖析投资者对各类资产市场的预期与共识，预判各类资产市场的趋势与可能的拐点，根据其

风险收益比，在固定收益类资产和权益类资产之间进行动态灵活配置，确定或调整各类资产的最优配置比例和整个组合的风险水平。

在股票市场处于相对高位、预期下跌风险加大的情况下，本基金将加大对固定收益类资产的投资，以便在大盘下跌时提供较好的下方风险保护；在股票市场处于相对低位，预期市场出现反转的可能性加大时，本基金将逐渐加大对权益类资产的投资，以获取新股上涨所带来的收益。

固定收益类资产中，本基金将主要通过大类资产配置、分类资产配置自上而下进行债券投资管理，以达到稳定收益和充分流动性的投资目标。

大类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可转债（含分离交易可转债）和其他普通债券进行选择配置，同时也在银行间市场、交易所市场进行选择配置。

分类资产配置主要通过分析债券市场变化、品种间相对价值变化、债券供求关系变化等因素，结合各债券品种的风险收益比、流动性水平等指标，采取主动管理的投资策略，定期和不定期地对投资组合类属资产配置进行优化，以寻求风险、收益、流动性之间的最佳平衡。

2. 债券投资策略

（1）可转债投资策略

可转债是上市公司发行的一种特殊的债券，债券在发行的时候规定了到期转换的价格，债权人可以根据市场行情把债券转换成股票，也可以把债券持有到期归还本金并获得利息。可转债的投资人具有在一定条件下转股和回售的权利，因此其理论价值应当等于作为普通债券的基础价值加上可转换公司债内含期权价值，是一种既具有债性，又具有股性的混合债券产品，具有抵御价格下行风险，分享股票价格上涨收益的特点。

可转债的理论价值应为纯债券部分的价值和可转债的嵌入期权价值之和。可转债纯债价值的大小主要由债券年利息、贴现率、距离到期时间和市场利率来决定。嵌入期权价值可使用 Black-Scholes 模型或二叉树模型来计算。

本基金将采用定性（行业地位、竞争优势、公司治理、产能、创新能力、财务状况等）与定量（PB、PE、PEG、PS、净资产收益率、预测未来两年主营业务利润复合增长率等）相结合的方法来构建可转债投资组合，重点投资价值被市场低估、发债公司具有较好发展潜力、基础股票具有较高上升预期的个券品种。首先，比较可转债的市场价格和根据量化模型测算出的理论价值，初选价值被低估的个券；在此基础上，对发债公司的基本面及正股的市场情况进行分析，加大对行业发展前景良好、发债公司具有较大增长潜力或正股有着较高上涨预期的可转债的投资。

在转股期内，可根据可转债正股价格相对转股价格所处的不同区间，分别采取不同的投资策略：当正股价格远低于转股价格时，可转债的市价逐步接近其债券价值，本基金可持有可转债以

获得稳定的投资收益，同时把握可能的转股价格修正对期权价值的提升所带来的机会；当正股价格在转股价格附近波动，本基金可重点投资正股基本面较好、未来股价有较大上升空间的可转债；当正股价格远高于转股价格时，可转债价格波动的特征与正股的波动日益趋近。本基金将密切关注正股股价的走向和赎回条款的满足程度，力争在满足赎回触发条件前，及时地将可转债转换成股票或直接在二级市场卖出可转债，以规避赎回风险。

分离交易可转债，是认股权证和公司债的组合产品，该种产品中的公司债和认股权证可在上市后分别交易，即发行时是组合在一起的，而上市后则自动拆分成公司债和认股权证。分离交易可转债与普通可转债的本质区别在于债券与期权可分离交易：分离交易可转债的投资者在行使了认股权利后，其债权依然存在，仍可持有到期归还本金并获得利息；而普通可转债的投资者一旦行使了认股权利，则其债权就不复存在了。

本基金将通过权证估值模型计算认股权证的价值，通过信用分析、利率及流动性分析，估算纯债部分的投资价值，并在结合两者的基础上，综合研判，积极参与分离交易可转债的投资。

本基金不从二级市场买入权证，因认购分离交易可转债所获得的认股权证自可交易之日起三个月内全部卖出。分离交易可转债上市后分离出的公司债的投资按照普通债券投资策略进行管理。

（2）普通债券投资策略

本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期，结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。

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，需综合评价各券收益率、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。主要运用的策略有：

1）久期策略

基于对宏观经济环境的深入研究，预期未来市场利率的变化趋势，结合基金未来现金流的分析，确定投资组合平均剩余期限。如果预测未来利率将上升，则可以通过缩短组合平均剩余期限的办法规避利率风险，相反，如果预测未来利率下降，则延长组合平均剩余期限，赚取利率下降带来的超额回报。

2）收益率曲线策略

收益率曲线策略是根据收益曲线的非平行移动调整资产组合，将预期到的变动资本化。其中有三种方式可以选择：子弹策略是将偿还期限高度集中于收益率曲线上的某一点；哑铃策略是将偿还期限集中于曲线的两端，即重点投资于期限较短的债券和期限较长的债券，弱化中期债的投资；而梯形策略是当收益率曲线的凸起部分均匀分布时，集中投资于这几个凸起部分所在年期的债券。

3）利差策略

基于不同债券市场板块间利差而在组合中分配资产的方法。收益率利差包括信用利差、可提前赎回和不可提前赎回证券之间的利差等表现形式。信用利差存在于不同债券市场，如国债和企业债利差、国债与金融债利差、金融债和企业债利差等；可提前赎回和不可提前赎回证券之间的利差形成的原因是基于利率预期的变动。

4）骑乘策略

当债券收益率曲线比较陡峭时，也即相邻期限利差较大时，可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平处于相对高位的债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，对应的将是债券价格的走高，而这一期间债券的涨幅将会高于其他期限的债券，以此来获取一定的价差收益。

5）信用分析策略

国债和央行票据是以国家税收信用作为担保，信用风险几乎为零。而对于企业债、公司债、金融债等品种，其发行人的信用等级是存在差异的。本基金将根据深入分析债券发行人所处行业发展前景、发展状况、市场地位、财务状况、管理水平和债务水平等因素，评价债券发行人的信用风险，并根据特定债券的发行契约，评价债券的信用级别，确定债券的信用风险。

6）息差策略

当回购利率低于某只债券的收益率时，通过回购融资投资于该债券，等该债券的收益兑现后再弥补回购融资成本，这样可以赚取两者间的利差收益。息差策略实际上也就是杠杆放大策略，进行放大策略时，必须考虑回购资金成本与债券收益率之间的关系。本基金将选择适当的杠杆比率，谨慎实施息差策略，以提高投资组合收益水平。

（3）资产支持证券投资策略

资产支持证券是指将缺乏流动性但可预测未来现金流的资产组成资产池并以资产池所产生的现金流作为偿付基础的证券品种。本基金通过深入分析市场利率、支持资产的构成及质量、发行条款、提前偿还率、违约率等，评估资产支持证券的内在价值，并进行谨慎投资。

3. 新股申购策略

本基金将依靠公司投研系统，对新股进行深入分析，确定股票内在价值，结合市场估值水平，来预测上市价格，同时考虑市场利率水平及股票中签率，综合评估新股的投资价值，谨慎参与新股申购，获取股票一级市场与二级市场的价差收益，申购所得的股票在其可交易之日起三个月内全部卖出。

4.投资决策程序

（1）研究部负责投资研究和分析

宏观研究人员通过研究经济形势、经济政策（货币政策、财政政策、区域政策、产业政策等）等，撰写宏观研究报告，就基金的资产配置提出建议。

债券研究人员在预测未来利率走势的基础上，研究债券的收益率、风险特征和久期，对债券品种的类别配置及个券投资提出具体建议。

行业研究人员根据数量化模型及对新股基本面的考察，确定对股票的投资建议。

（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，定期将对债券和股票的分析结果提交给研究部、基金经理和投资决策委员会。

（3）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，根据研究部、量化投资部和投资管理部提交的报告，就基金重大战略，包括组合资产配置、债券组合久期、债券类别配置等做出决策。

（4）基金经理负责投资执行

基金经理在公司研究团队和风险评估小组的协助与支持下，向投资决策委员会提交投资计划，并在投资决策委员会确定的范围内，构建和调整投资组合，向交易部下达投资指令。

（5）绩效评估

绩效评估人员利用相关工具对基金的投资风格、投资风险进行评估，测算经风险调整后的投资绩效，并对业绩贡献进行分析。

（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。

(四)业绩比较基准

中信标普可转债指数收益率×70% +上证国债指数收益率×30%。

中信标普可转债指数由中信标普指数公司推出，最大限度地涵盖了在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的可转债，市场覆盖面广、代表性高。上证国债指数以上海证券交易所上市的所

有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成。该指数反映了中国债券市场整体变动情况。本基金认为，该业绩比较基准能较好地反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金可以在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案，并及时公告，但不需要召开基金份额持有人大会。

（五）风险收益特征

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金和股票型基金，高于货币市场基金。本基金重点配置可转债（含分离交易可转债），在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。

（六）投资限制

1．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)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，但是国务院另有规定的除外；

(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)依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；

(9)法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2．投资组合限制

本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，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

（2）本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；

（3）本基金基金财产参与股票发行申购时所申报的金额不得超过基金的总资产，所申报的股

票数量不得超过拟发行股票公司该次发行股票的总量；

（4）本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。其它权证的投资比例，遵从法规或监管部门的相关规定；

（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％；本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

（6）本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于可转债（含分离交易可转债）的比例不低于固定收益类资产的 80%；投资于权益类资产的比例不高于基金资产的 20%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 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％；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％；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％；

（8）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％；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；

（9）本基金资产投资不得违反法律法规及基金合同规定的其他比例限制。

对于因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等原因导致基金的投资不符合基金合同的约定的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到上述标准。法律、法规另有规定时，从其规定。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，本基金不受上述限制。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。

（七）基金管理人代表基金行使股东权利及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及债权人权利，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。

（八）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。

（九）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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	99,097,006.23	95.67
	其中：债券	99,097,006.23	95.67
	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	225,207.63	0.22
8	其他资产	4,260,021.28	4.11
9	合计	103,582,235.14	100.00

2、 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	1,087.60	0.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,985,000.00	12.80
	其中：政策性金融债	9,985,000.00	12.80
4	企业债券	16,377,230.00	20.99
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	72,733,688.63	93.23
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	99,097,006.23	127.03

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

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	110031	航信转债	214,480	27,830,924.80	35.67
2	132003	15 清控 EB	104,000	12,147,200.00	15.57
3	110032	三一转债	90,000	10,101,600.00	12.95
4	090408	09 农发 08	100,000	9,985,000.00	12.80
5	113009	广汽转债	83,000	9,940,910.00	12.74

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

10、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	12,060.51
2	应收证券清算款	3,977,031.11
3	应收股利	-
4	应收利息	154,577.78
5	应收申购款	116,351.88
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,260,021.28

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	110031	航信转债	27,830,924.80	35.67
2	110030	格力转债	1,719,200.00	2.20
3	128009	歌尔转债	1,267,200.00	1.62
4	113008	电气转债	1,069,380.00	1.37

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

十一、基金的业绩

基金业绩截止日为 2016 年 3 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:

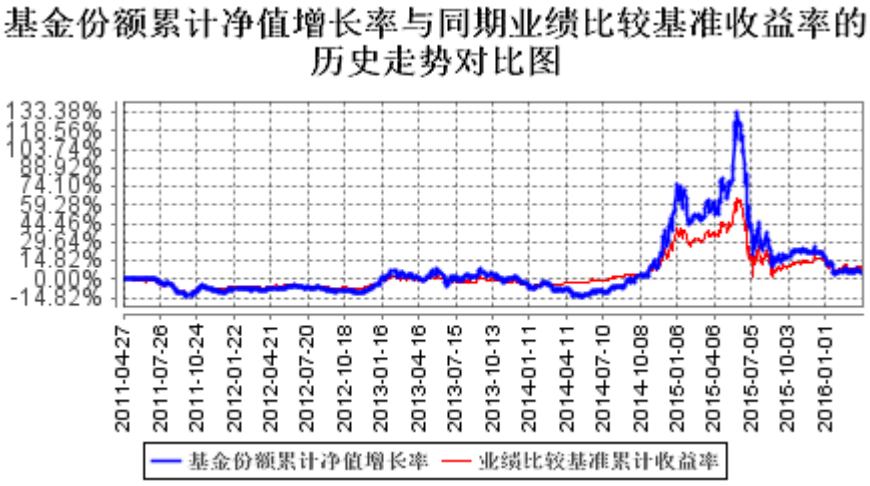
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
2011/04/27-2011/12/31	-10.10%	0.52%	-7.93%	0.45%	-2.17%	0.07%
2012/01/01-2012/12/31	5.72%	0.34%	4.22%	0.25%	1.50%	0.09%
2013/01/01-2013/12/31	2.73%	0.95%	0.31%	0.45%	2.42%	0.50%
2014/01/01-2014/12/31	62.96%	1.43%	39.14%	0.74%	23.82%	0.69%
2015/01/01-2015/12/31	-26.22%	3.00%	-14.57%	2.20%	-11.65%	0.80%
2016/01/01-2016/3/31	-10.15%	0.81%	-4.28%	0.79%	-5.87%	0.02%
2011/04/27-2016/03/31	5.48%	1.59%	9.52%	1.10%	-4.04%	0.49%

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：

华宝兴业可转债债券型证券投资基金

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

（2011 年 4 月 27 日至 2016 年 3 月 31 日）



注：按照基金合同规定,自基金成立日期的 6 个月内达到规定的资产组合,截至 2011 年 10 月 27 日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

十二、基金财产

(一)基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

(二)基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(三)基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

(四)基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

十三、基金资产估值

(一)估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

(二)估值方法

1．证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（3)交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息（自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息）得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2．处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

（2）首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确

定公允价值。

3．全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4．同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5．如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

6．相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

(三)估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

(四)估值程序

1.基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2．基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

(五)估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生差错时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1．差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或

投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

2．差错处理原则

(1)差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方对直接损失承担赔偿责任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

(2)差错的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3)因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”)，则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4)差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5)差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

(6)如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权

向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的直接损失。

(7)按法律法规规定的其他原则处理差错。

3．差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1)查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2)根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3)根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4)根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

4．基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

(1)基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2)错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案。

(3)因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(4)基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(5)前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

(六)暂停估值的情形

1．基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2．因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3．占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；

4．中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(七)基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日或国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非工作日的基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后

发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

(八)特殊情况的处理

1. 基金管理人或基金托管人按估值方法的第 5 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2. 由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

十四、基金收益与分配

（一）基金利润

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额；基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

（二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日（即可供分配利润计算截至日，下同）基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

（三）收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

1．本基金的每一基金份额享有同等收益分配权；

2．基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3．在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配四次，每次基金收益分配比例不得低于截至收益分配基准日的可供分配利润的 10%；

4．基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

5．本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。与基金分红方式的设置与变更相关的规则在招募说明书中列示；

6．基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不得超过 15 个工作日；

7．收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额。

（四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益分配基准日以及该日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

（五）收益分配的时间和程序

1．基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案；

2．在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

十五、基金的费用

（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．基金财产拨划支付的银行费用；

4．基金合同生效后的基金信息披露费用；

5．基金份额持有人大会费用；

6．基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

7．基金的证券交易费用；

8．依法可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（三）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，基金管理费按基金资产净值的 1.3%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×1.3%÷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，经基金托管人复核后于次月首日起 5 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、休息日，支付日期顺延。

2．基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.25%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

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，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3．除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（四）不列入基金费用的项目

基金合同生效前的律师费、会计师费和信息披露费用不得从基金财产中列支。基金管理人与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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

（五） 基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

（六）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十六、基金的会计与审计

（一）基金的会计政策

1．基金管理人为本基金的会计责任方；

2．本基金的会计年度为公历每年的 1 月 1 日至 12 月 31 日；

3．本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4．会计制度执行国家有关的会计制度；

5．本基金独立建账、独立核算；

6．基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7．基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

（二）基金的审计

1.基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。

2．会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人同意。

3．基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人(或基金管理人)同意，并报中国证监会备案后可以更换。就更换会计师事务所，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

十七、基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊(以下简称“指定报刊”)和基金管理人、基金托管人的互联网网站(以下简称“网站”)等媒介披露。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1.虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；

2.对证券投资业绩进行预测；

3.违规承诺收益或者承担损失；

4.诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构；

5.登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；

6.中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

公开披露的基金信息包括：

(一)招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后，基金管理人应当在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的 15 日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。更新后的招募说明书公告内容的截止日为每 6 个月的最后 1 日。

(二)基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额发售的 3 日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管

理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

(三)基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

(四)基金合同生效公告

基金管理人将在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

(五)基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

1.本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；

2.在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值；

3.基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日（或自然日）基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日（或自然日）的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

(六)基金份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

(七)基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告

1.基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露；

2.基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上；

3.基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上；

4.基金合同生效不足 2 个月的，本基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

5.基金定期报告应当按有关规定分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证

监会派出机构备案。

(八)临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件时，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案：

1.基金份额持有人大会的召开及决议；

2.终止基金合同；

3.转换基金运作方式；

4.更换基金管理人、基金托管人；

5.基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

6.基金管理人股东及其出资比例发生变更；

7.基金募集期延长；

8.基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；

9.基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；

10.基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；

11.涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；

12.基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；

13.基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；

14.重大关联交易事项；

15.基金收益分配事项；

16.管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

17.基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；

18.基金改聘会计师事务所；

19.基金变更、增加或减少代销机构；

20.基金更换注册登记机构；

21.本基金开始办理申购、赎回；

22.本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

23.本基金发生巨额赎回并延期支付；

24.本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；

25.本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；

26.中国证监会或基金合同规定的其他事项。

(九)澄清公告

在基金合同存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

(十)基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并自生效之日起 2 日内在指定媒体予以公告。

(十一)中国证监会规定的其他信息

(十二)信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地，供公众查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

十八、风险揭示

（一）投资于本基金的风险

1．市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化，产生风险，主要包括：

（1）政策风险：因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

（2）经济周期风险：随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于债券与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

（3）利率风险：金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

（4）再投资风险

市场利率下降将影响固定收益类证券利息收入的再投资收益率,这与利率上升所带来的价格风险互为消长。

2．流动性风险

因市场交易量不足,导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。流动性风险还包括由于本基金出现投资者大额赎回,致使本基金没有足够的现金应付基金赎回支付的要求所引致的风险。

3．信用风险

债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息,或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险,信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

4．本基金特有风险

本基金以可转债为主要投资对象，该类债券的流动性较差，可能会影响基金构建投资组合和及时实现资产变现。本基金可能对部分看好的可转债进行集中投资和长期持有，因流动性、交易价格波动等原因，基金净值可能发生短期波动。可转债正股价格的波动可能会影响可转债的内在价值，从而影响其市场价格，导致收益的不确定性。另外，作为债券基金的持有人，投资者还要承担债券发行人出现违约引起的信用风险等等。

5．管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人对经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不全、投资操作出现失误，都会影响基金的收益水平。

6．操作或技术风险

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交

易的正常进行或者导致投资人的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等。

7．合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

8．其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金财产的损失。

金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

（二）声明

1．本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资人自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

2．除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过代销机构代理销售，但是，基金并不是代销机构的存款或负债，也没有经代销机构担保或者背书，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

十九、基金合同的变更、终止与基金财产清算

(一)基金合同的变更

1.基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

(1)转换基金运作方式；

(2)变更基金类别；

(3)变更基金投资目标、投资范围或投资策略；

(4)变更基金份额持有人大会程序；

(5)更换基金管理人、基金托管人；

(6)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

(7)本基金与其他基金的合并；

(8)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

(9)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：

(1)调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

(2)在法律法规和基金合同规定的范围内变更基金的申购费率或收费方式、调低赎回费率；

(3)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(4)对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(5)基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

(6)按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2. 关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自持有人大会决议通过后生效，自决议生效后两日内在指定媒介公告，并在决议生效 5 日内报中国证监会备案。

(二)基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同将终止：

1.基金份额持有人大会决定终止的；

2.基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内

无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

3.基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

4.中国证监会规定的其他情况。

(三)基金财产的清算

1.基金财产清算组

(1) 自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2)基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

(3)基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

2.基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

(1)基金合同终止后，发布基金财产清算公告；

(2)基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；

(3)对基金财产进行清理和确认；

(4)对基金财产进行估价和变现；

(5)聘请会计师事务所对清算报告进行审计；

(6)聘请律师事务所出具法律意见书；

(7)将基金财产清算结果报告中国证监会；

(8)参加与基金财产有关的民事诉讼；

(9)公布基金财产清算结果；

(10)对基金剩余财产进行分配。

3.清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

4.基金财产按下列顺序清偿：

(1)支付清算费用；

(2)交纳所欠税款；

(3)清偿基金债务；

(4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

5.基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

6.基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

二十、基金合同的内容摘要

（一）基金合同当事人权利及义务

1．基金管理人的权利与义务

（1）基金管理人的权利

1）自基金合同生效之日起，依照有关法律法规和基金合同的规定独立运用基金财产；

2）依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

3）销售基金份额；

4）依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

5）在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；

6）根据基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

7）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；

8）在法律法规或监管机构允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；

9）自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

10）选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

11）选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

12）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

13）依法召集基金份额持有人大会；

14）法律法规和基金合同规定的其他权利。

（2）基金管理人的义务

1）依法募集基金，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）办理基金备案手续；

3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

6）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7）依法接受基金托管人的监督；

8）计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

9）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

10）按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

11）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

12）编制中期和年度基金报告；

13）严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

14）保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

15）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；

16）依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

17）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；

18）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；

19）组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

20）因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21）基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22）按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

23）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

24）执行生效的基金份额持有人大会决议；

25）不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

26）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

27）法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

2．基金托管人的权利与义务

（1）基金托管人的权利

1）依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

2）监督基金管理人对本基金的投资运作；

3）自基金合同生效之日起，依法保管基金资产；

4）在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

5）根据基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会；

6）依法召集基金份额持有人大会；

7）按规定取得基金份额持有人名册资料；

8）法律法规和基金合同规定的其他权利。

（2）基金托管人的义务

1）安全保管基金财产；

2）设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

3）对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；

4）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

7）保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

8）对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

9）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

10）按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

11）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

12）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；

13）按照规定监督基金管理人的投资运作；

14）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

15）依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

16）按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

17）因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

18）基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

19）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

20）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；

21）执行生效的基金份额持有人大会决议；

22）不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

23）保存基金份额持有人名册；

24）法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

3．基金份额持有人的权利和义务

（1）基金份额持有人权利

1）分享基金财产收益；

2）参与分配清算后的剩余基金财产；

3）依法申请赎回其持有的基金份额；

4）按照规定要求召开基金份额持有人大会；

5)出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

7）监督基金管理人的投资运作；

8）对基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

9）法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

（2）基金份额持有人义务

1）遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；

2）交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；

3）在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

4）不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；

5）执行生效的基金份额持有人大会决议；

6）返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；

7）法律法规和基金合同规定的其他义务。

（二） 基金份额持有人大会

1.基金份额持有人大会由基金份额持有人及其合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

2.当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额 10%以上(含10%，下同)的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同)就同一事项提议时，应当召开基金份额持有人大会：

(1)终止基金合同；

(2)转换基金运作方式；

(3)变更基金类别；

(4)变更基金投资目标、投资范围或投资策略；

(5)变更基金份额持有人大会程序；

(6)更换基金管理人、基金托管人；

(7)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；

(8)本基金与其他基金的合并；

(9)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

(10)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

3. 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

(1)调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

(2)在法律法规和基金合同规定的范围内变更基金的申购费率或收费方式、调低赎回费率；

(3)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(4)对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(5)基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

(6)按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

4.会议召集人及召集方式

（1） 除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

（2） 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

（3） 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

（4） 代表基金份额10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

（5） 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

5. 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

(1)会议召开的时间、地点和出席方式；

(2)会议拟审议的主要事项；

(3)会议形式；

(4)议事程序；

(5)有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；

(6)代理投票的授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点；

(7)表决方式；

(8)会务常设联系人姓名、电话；

(9)出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(10)召集人需要通知的其他事项。

采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

6. 基金份额持有人出席会议的方式

（1） 会议方式

1)基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

2)现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

3)通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

4)会议的召开方式由召集人确定，但决定转换基金运作方式、更换基金管理人和基金托管人、终止基金合同的事宜必须以现场开会方式召开。

（2） 召开基金份额持有人大会的条件

1)现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

① 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%，下同)；

② 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及

会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

2)通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

① 召集人按基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

② 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

③ 召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

④ 本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上；

⑤ 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。

7．议事内容与程序

（1）议事内容及提案权

1)议事内容为基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

2)基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

3)对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4)单独或合并持有权益登记日基金总份额 10％以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于

6 个月。法律法规另有规定的除外。

5)基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

（2）议事程序

1)现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；基金托管人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金管理人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名(或单位名称)等事项。

2)通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

（3）基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

8．决议形成的条件、表决方式、程序

（1）基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

（2）基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1)一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的 50%以上通过方为有效，除下列 2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

2)特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必

须以特别决议通过方为有效。

（3）基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

（4）采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

（5）基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

（6）基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

9．计票

（1）现场开会

1)如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

2)监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果。

3)如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

（2）通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

10．基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

（1）基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

（2）生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。

（3）基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒体公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

11．法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

（三）基金合同的变更和终止

1．基金合同的变更

基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意：

(1)转换基金运作方式；

(2)变更基金类别；

(3)变更基金投资目标、投资范围或投资策略；

(4)变更基金份额持有人大会程序；

(5)更换基金管理人、基金托管人；

(6)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

(7)本基金与其他基金的合并；

(8)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

(9)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：

(1)调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

(2)在法律法规和基金合同规定的范围内变更基金的申购费率或收费方式、调低赎回费率；

(3)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(4)对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(5)基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

(6)按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起 2 日内在至少一种指定媒体公告。

2．基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同将终止：

（1）基金份额持有人大会决定终止的；

（2）基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

（3）基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

（4）中国证监会规定的其他情况。

（四）争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

基金合同受中国法律管辖。

（五）基金合同的存放和获得方式

基金管理人应在基金份额发售的 3 日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

二十一、基金托管协议内容摘要

（一）托管协议当事人

1．基金管理人

名称：华宝兴业基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

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 58 楼

邮政编码：200120

法定代表人：郑安国

成立时间：2003 年 3 月 7 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监基金字[2003]19 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务。

2．基金托管人

名称：招商银行股份有限公司(简称：招商银行)

住所：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

邮政编码：518040

法定代表人：傅育宁

成立时间：1987 年 4 月 8 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2002]83 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务。外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；结汇、售汇；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营和代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸金融业务。经中国人民银行批准的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 215.77 亿元

存续期间：持续经营

（二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。

（1）本基金将投资于以下金融工具：

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 A 股股票（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、货币市场工具、权证、资产支持证券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，但需符合中国证监会的相关规定。

本基金所投资的固定收益类资产包括：国债、央行票据、金融债、公司债、企业债、可转债（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、银行存款、债券回购等。

本基金不可直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与一级市场新股申购或增发新股，并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资分离交易可转债而产生的权证等。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金应在其可交易（即不受锁定期等任何交易限制）之日起的三个月内卖出。

（2）本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

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。

对基金管理人发送的不符合基金合同规定的投资行为的指令，基金托管人可以拒绝执行，并书面通知基金管理人；对于已经执行的投资，基金托管人发现该投资行为不符合基金合同的规定的，基金托管人应书面通知基金管理人进行整改，并将该情况报告中国证监会。

2. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应事先向基金托管人提供投资品种池，以便基金托管人对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。

本基金的投融资比例：本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于可转债（含分离交易可转债）的比例不低于固定收益类资产的 80%；投资于权益类资产的比例不高于基金资产的 20%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金投资组合遵循以下投资限制：

(1)本基金持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

(2)本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券

的 10%；

(3)本基金基金财产参与股票发行申购时所申报的金额不得超过基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司该次发行股票的总量；

(4)本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。其它权证的投资比例，遵从法规或监管部门的相关规定；

(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％；本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(6) 本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于可转债（含分离交易可转债）的比例不低于固定收益类资产的 80%；投资于权益类资产的比例不高于基金资产的 20%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 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％；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％；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％；

(8)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％；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；

(9)本基金资产投资不得违反法律法规及基金合同规定的其他比例限制。

对于因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等原因导致基金的投资不符合基金合同的约定的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到上述标准。法律、法规另有规定时，从其规定。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，本基金不受上述限制。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。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。

3. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后的监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，如基金托管人提醒基金管理人后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中

国证监会报告。

4. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单。基金管理人有责任确保及时将更新后的交易对手名单发送给基金托管人，否则由此造成的损失应由基金管理人承担。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。在基金存续期间基金管理人可以调整交易对手名单，但应将调整结果至少提前一个工作日书面通知基金托管人。新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失。若未履约的交易对手在基金管理人确定的时间内仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

5. 本基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

（1）本协议所称的流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

本基金可以投资经中国证监会批准的非公开发行证券，且限于由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管的，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

基金不得投资未经中国证监会批准的非公开发行证券。

基金参与非公开发行证券的认购，不得预付任何形式的保证金，法律法规或中国证监会另有规定的除外。

基金不得投资有锁定期但锁定期不明确的证券，且锁定期不得超过本基金的剩余期限。

（2）基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次发送投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或

其他双方认可的方式确认收到上述资料。

基金管理人对本基金投资受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。

（3）基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、应划付的认购款、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟发送投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

由于基金管理人未及时提供有关证券的具体的必要的信息，致使托管人无法审核认购指令而影响认购款项划拨的，基金托管人免于承担责任。

（4）基金托管人依照法律法规，《基金合同》，《托管协议》审核基金管理人投资流通受限证券的行为。如发现基金管理人违反了《基金合同》、《托管协议》以及其他相关法律法规的有关规定，应及时通知基金管理人，并呈报中国证监会，同时采取合理措施保护基金投资人的利益。基金托管人有权对基金管理人的违法、违规以及违反《基金合同》、《托管协议》投资指令不予执行，并立即通知基金管理人纠正，基金管理人不予纠正或已代表基金签署合同不得不执行时，基金托管人应向中国证监会报告。

6. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

7. 基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应及时核对并回复基金托管人，对于收到的书面通知基金管理人应以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

8. 基金管理人有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和托管协议对基金业务执行核查。包括但不限于：对基金托管人发出的提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

9. 若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人及时纠正，由此造成的损失由基金

管理人承担。

10．基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

（三）基金管理人对基金托管人的业务核查

1．基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2．基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到书面通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。

3．基金托管人有义务配合和协助基金管理人依照法律法规、基金合同和托管协议对基金业务执行核查，包括但不限于：对基金管理人发出的书面提示，基金托管人应在规定时间内答复并改正，或就基金管理人的疑义进行解释或举证；基金托管人应积极配合提供相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性。

4．基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

（四）基金财产保管

1．基金财产保管的原则

（1）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

（2）基金托管人应安全保管基金财产。

（3）基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

（4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。

（5）基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。

（6）对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。基金管理人未及时催收给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失。

（7）基金托管人应安全、完整地保管基金资产；未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。不属于基金托管人实际有效控制下的实物证券的损坏、灭失，基金托管人不承担责任。

（8）除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

2．基金募集期间及募集资金的验资

（1）基金募集期间募集的资金应存放于“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

（2）基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，基金管理人应聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

（3）若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

3．基金银行账户的开立和管理

（1）基金托管人以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，保管基金的银行存款，并根据基金管理人的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人刻制、保管和使用。

（2）基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

（3）基金银行账户的开立和管理应符合法律法规及银行业监督管理机构的有关规定。

4．基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

若中国证监会或其他监管机构在托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规

定执行。

5．债券托管账户的开立和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

6．其他账户的开设和管理

因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，由基金管理人协助基金托管人按照有关法律法规和基金合同的约定开立。新账户按有关规定使用并管理。法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

7．基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证按约定由基金托管人存放于基金托管人的保管库，或存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，实物保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由上述存放机构及基金托管人以外机构实际有效控制的有价凭证不承担保管责任。

8．与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

（五）基金资产净值计算与复核

1．基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数，基金份额净值的计算，精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，经基金托管人复核，按规定公告。

2．复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

3．根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金

的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

（六）基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称、证件号码和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其的真实性、准确性和完整性。基金管理人和托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

（七）争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为上海市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

（八）托管协议的变更与终止

1．托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准或备案后生效。

2．基金托管协议终止的情形

（1）基金合同终止；

（2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；

（3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；

（4）发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

二十二、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人有权根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目及内容。主要服务内容如下：

（一）资料寄送

投资人更改个人信息资料，请及时到原开立华宝兴业基金账户的销售网点更改。

在从销售机构获取准确的客户地址、邮编和电子邮件地址的前提下，基金管理人将负责寄送以下资料：

1．开户确认书

在基金存续期间开户的，在每个季度结束后15个工作日内向投资人寄送。

2．基金投资人对账单

基金管理人将在每月度结束后的3个工作日内,向已经定制了电子对账单服务的基金份额持有人提供电子对账单。如基金持有人因特殊原因需要获取指定期间的纸质对账单，可拨打我公司客服电话400-700-5588（免长途话费）、021-38924558，按“0”转人工服务，提供姓名、开户证件号码或基金账号、邮寄地址、邮政编码、联系电话，客服人员核对信息无误后，为基金持有人免费邮寄纸质对账单。

3．其他相关的信息资料

(二)红利再投资

本基金收益分配时,基金份额持有人可以选择将所获红利再投资于本基金,登记注册机构将其所获红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资免收申购费用。

（三）定期定额投资计划

1、定义

本基金的＂定期定额投资计划＂是指投资人可通过本基金管理人指定的销售机构提交申请，约定每月扣款时间、扣款金额，由指定的销售机构于每月约定扣款日在投资人指定资金账户内自动完成扣款和基金申购申请的一种长期投资方式。投资者在办理本业务的同时，仍然可以进行日常申购、赎回业务。

2、办理时间

本业务申请受理时间为开放式基金法定开放日9：30－15：00

3、办理场所

目前，我公司直销e网金、招商银行、中国建设银行、中国银行、交通银行、中国民生银行、

中信银行、平安银行、上海浦东发展银行、兴业银行、江苏银行、渤海银行、国泰君安证券、光大证券、海通证券、中国银河证券、中信建投证券、招商证券、广发证券、长江证券、东吴证券、申万宏源证券、平安证券、中信证券、兴业证券、国信证券、华泰证券、恒泰证券、长城证券、中投证券、安信证券、华宝证券、中泰证券、华福证券、信达证券、江海证券、东北证券、德邦证券、华安证券、山西证券、众禄金融控股股份有限公司、上海好买基金销售公司、杭州数米基金销售公司、上海天天基金销售公司、和讯信息科技有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问公司、深圳腾元基金销售公司、浙江同花顺基金销售公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司、中经北证（北京）资产管理有限公司已开通本基金的定期定额投资业务。其中，中国建设银行只接受个人投资者的申请。

本公司新增其他销售机构开办此业务时，将另行公告。

4、申请方式

（1）凡申请办理本业务的投资者，须先开立本公司开放式基金账户（已开户者除外），具体开户程序应遵循销售机构的相关规定。

(2)已开立本公司开放式基金账户的投资者,请到销售机构的各营业网点申请办理此项业务，具体办理程序应遵循各销售机构的相关规定。

5、扣款日期

投资者应按照销售机构的业务规则，与销售机构约定每月固定扣款日期，该扣款日期视为申购申请日（T日）；若遇约定的固定扣款日期为非基金申购开放日，则下一基金申购开放日为实际扣款日（T日）。

6、扣款金额

投资者应与销售机构就申请开办本业务约定每月固定扣款（申购）金额，具体最低扣款金额以各代销机构的规定为准。投资者通过本公司直销e网金办理本业务时，每期扣款金额最低不少于人民币100元（含申购费）。

7、扣款方式

销售机构将按照投资者申请时所约定的每月固定扣款日、扣款金额扣款，若遇非基金开放日则顺延到下一基金开放日；如因投资者提交变更、解约等申请而使扣款信息与注册登记机构确认的约定信息不符或基金管理人发布暂停定期定额投资业务公告等情况，则此次扣款不成功。投资者需指定一个销售机构认可的资金账户作为每月固定扣款账户。如投资者账户余额不足的，应遵循相关销售机构的规定处理。

8、申购费率

若无另行公告，定期定额申购费率与正常的申购业务相同。部分销售机构处于定期定额申购费率优惠活动（包括网上交易）期间的，本基金将依照各销售机构的相关规定执行。本公司直销e网金的定期定额优惠申购费率详见本公司的公告及网站。

9、交易确认

以每月实际扣款日（T日）的基金份额净值为基准计算申购份额。基金份额确认日为T+1日，投资者可在T＋2日到销售机构各销售网点查询基金申购确认情况。

10、本业务的变更和终止

（1）投资者变更每月扣款金额、扣款日期、扣款账户等信息，须到原销售网点申请办理业务变更手续，具体办理程序应遵各销售机构的相关规定；

（2）投资者终止本业务，须携带本人有效身份证件及相关业务资料到原销售机构申请办理业务终止手续，具体办理程序应遵循各销售机构的相关规定；

（3）本业务变更和终止的生效日应遵循各销售机构的具体规定。

（四）在线服务

基金管理人利用自己的网站（www.fsfund.com）为基金投资人提供网上查询、网上资讯服务。

（五）资讯服务

1．投资人如果想了解申购与赎回的交易情况、基金账户份额、基金产品与服务等信息，可拨打华宝兴业基金管理有限公司如下电话：

电话呼叫中心：4007005588，021-38924558该电话可转人工座席。

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

传真：021－50499663、50988055

2．互联网站

公司网址：www.fsfund.com

电子信箱：fsf@fsfund.com

(六)客户投诉和建议处理

投资人可以通过基金管理人提供的呼叫中心人工座席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。投资人还可以通过代销机构的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉。

二十三、其他应披露事项

（一）本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产的诉讼；基金未进行收益分配；基金管理人及其高级管理人员未受监管部门的稽查与处罚。

（二）本报告期内，本基金在指定媒体刊登的公告如下：2015 年 11 月 19 日刊登了《华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中国工商银行股份有限公司开通转换业务的公告》、2016 年 1 月 4 日刊登了《华宝兴业基金管理有限公司旗下基金资产净值公告》、2016 年 1 月 4 日刊登了《华宝兴业基金管理有限公司关于因指数熔断调整公司旗下部分基金开放时间的公告》、2016 年 1 月 6 日刊登了《华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行“2016 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告》、2016 年 1 月 6 日刊登了《华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加国都证券有限责任公司申购费率优惠活动的公告》、2016 年 1 月 6 日刊登了《关于华宝兴业现金宝货币基金工薪宝 APP 转换业务费率优惠的公告》、2016 年 1 月 7 日刊登了《华宝兴业基金管理有限公司关于因指数熔断调整公司旗下部分基金开放时间的公告》、2016 年 1 月 21 日刊登了《华宝兴业可转债债券型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告》、2016 年 1 月 27 日刊登了《华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加渤海银行申购及定投申购费率优惠活动的公告》、2016 年 2 月 24 日刊登了《关于华宝兴业现金宝货币基金工薪宝 APP 转换业务费率优惠的公告》、2016 年 3 月 28 日刊登了《华宝兴业可转债债券型证券投资基金 2015 年度报告（摘要）》、2016 年 4 月 12 日刊登了《华宝兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海联泰资产管理有限公司为代销机构及费率优惠的公告》、2016 年 4 月 20 日刊登了《华宝兴业可转债债券型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告》。

二十四、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书公布后，分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的住所，供公众查阅、复制。基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

二十五、备查文件

以下文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资人查阅。

（一）中国证监会核准华宝兴业可转债债券型证券投资基金募集的文件

（二）《华宝兴业可转债债券型证券投资基金基金合同》

（三）《华宝兴业可转债债券型证券投资基金托管协议》

（四）《华宝兴业基金管理有限公司开放式基金业务规则》

（五）法律意见书

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

（七）基金托管人业务资格批件和营业执照

（八）中国证监会要求的其他文件

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

华宝兴业基金管理有限公司

2016 年 6 月 7 日