

华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金 2016 年第 4 季度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 1 月 19 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 1 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业量化对冲混合
基金主代码	000753
交易代码	000753
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 9 月 17 日
报告期末基金份额总额	644,300,954.26 份
投资目标	在有效控制风险的基础上，运用股指期货等衍生工具对冲市场系统风险，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>在资产配置方面，本基金主要运用股指期货等空头工具对持有的股票等权益类多头组合进行对冲操作，规避权益类多头组合的市场系统性风险；同时预留必要的现金，以应对保证金的增加要求或投资者的赎回申请。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金主要采用量化行业配置模型和量化 Alpha 选股模型构建指数增强股票组合，严格控制运作风险，并根据市场变化趋势，定期对模型进行调整，以改进模型的有效性，最大化超额收益。量化行业配置模型在参考相关指数的行业权重分布的基础上，结合行业景气度、投资时钟、行业动量和行业超跌偏离度等基本面和技术面模型，在整体风险水平可控的前提下，实现各行业</p>

	<p>权重的优化配置。</p> <p>根据对中国证券市场运行特征的长期研究、投研团队的长期投资实践和大量历史数据的实证检验，基金管理人量化投资团队开发了量化 Alpha 选股模型。该模型现阶段主要考虑估值、成长、盈利质量、市场预期等基本面因子以及股权激励、并购、重要股东投资行为、业绩超预期等事件驱动因子，通过实证分析和动态跟踪，以超额收益的水平和稳定性为目标确定各因子的优化权重，根据该模型的综合评分结果，在各行业中选择股票构建股票投资组合。</p> <p>当股票投资组合构建完成后，本基金将进一步根据组合内个股价格波动、风险收益变化、特殊事件等实际情况，动态优化个股权重，使股票组合的整体风险处于可控范围内。</p> <p>3、空头工具投资策略</p> <p>现阶段，本基金主要运用股指期货合约进行套期保值操作，规避市场系统性风险。在完全套保的理念下，本基金根据股票多头组合的市值计算股指期货合约卖单量，并根据市场变化对股指期货合约卖单量进行动态跟踪并适时调整。同时，综合考虑定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在不同股指期货合约之间进行动态配置，并适时进行合约展期操作，以求提高组合收益和套期保值的效果。</p> <p>未来，在基金参与融资融券、转融通业务及投资期权等其他金融工具的相关规定颁布后，基金管理人将按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求，根据市场情况选择合适的空头工具对冲市场系统风险。</p> <p>4、其他绝对收益策略</p> <p>在主要利用市场中性策略获取 Alpha 收益的同时，本基金可根据市场情况的变化，适时运用其他绝对收益策略（如定向增发套利策略、并购套利策略、股指期货期现套利策略、股指期货跨期套利策略等），以求在控制市场系统性风险的前提下，进一步增强收益水平，降低收益波动性。</p> <p>5、固定收益类投资工具投资策略</p> <p>本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于债券、货币市场工具和资产支持证券，以保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。</p> <p>6、其他金融工具投资策略</p> <p>在法律法规许可的前提下，本基金可基于谨慎原则运用权证等相关金融衍生工具对基金投资组</p>
--	---

	合进行管理，以更好地实现本基金的投资目标。	
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）	
风险收益特征	本基金为特殊类型的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性，因此收益不一定能超越业绩比较基准。	
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华宝兴业量化对冲混合 A	华宝兴业量化对冲混合 C
下属分级基金的交易代码	000753	000754
报告期末下属分级基金的份额总额	491,891,166.05 份	152,409,788.21 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年10月1日—2016年12月31日）	
	华宝兴业量化对冲混合 A	华宝兴业量化对冲混合 C
1. 本期已实现收益	2,845,054.03	1,051,736.54
2. 本期利润	4,481,362.58	1,481,267.27
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0097	0.0142
4. 期末基金资产净值	496,724,084.74	154,152,888.81
5. 期末基金份额净值	1.0098	1.0114

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝兴业量化对冲混合 A

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
过去三个月	0.83%	0.03%	0.38%	0.01%	0.45%	0.02%

华宝兴业量化对冲混合 C

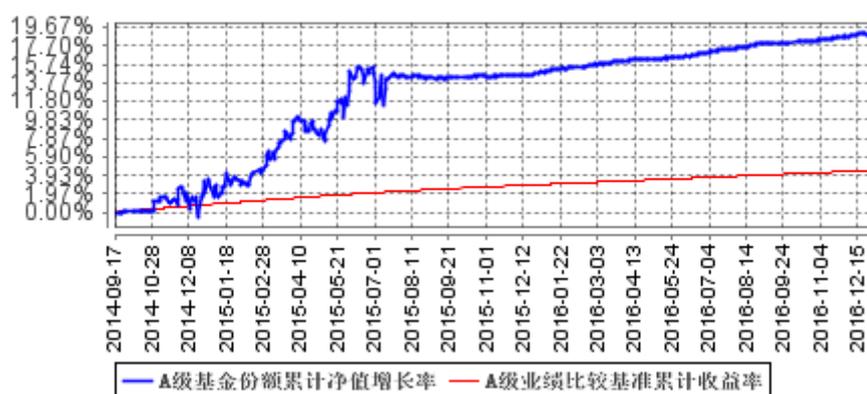
阶段	净值增长	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基准收	①—③	②—④
----	------	-------	-------	---------	-----	-----

	率①	标准差②	准收益率③	益率标准差④		
过去三个月	1.83%	0.12%	0.38%	0.01%	1.45%	0.11%

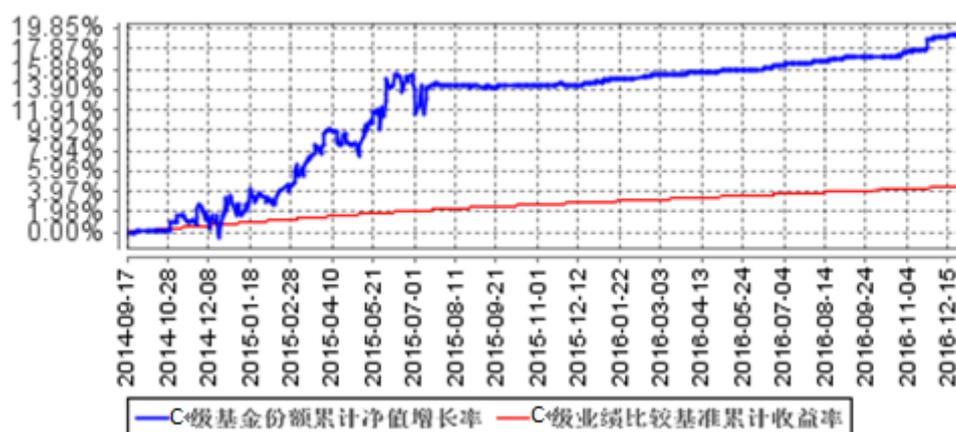
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2014 年 9 月 17 日至 2016 年 12 月 31 日)

A级基金份额累计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



C级基金份额累计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



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 2014 年 11 月 17 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐林明	助理投资总监、量化投资部总经理、本基金基金经理、华宝事件驱动混合、华宝沪深300增强基金经理	2014年9月17日	-	14年	复旦大学经济学硕士，FRM，曾在兴业证券、凯龙财经（上海）有限公司、中原证券从事金融工程研究工作。2005年8月加入华宝兴业基金管理有限公司，曾任金融工程部数量分析师、金融工程部副总经理。2009年9月至2015年11月任华宝兴业中证100指数型证券投资基金基金经理，2010年2月起任量化投资部总经理，2010年4月至2015年11月任华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2014年6月任助理投资总监，2014年9月兼任华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金经理。2015年4月起任华宝兴业事件驱动混合型证券投资基金基金经理。2016年12月起兼任华宝兴业沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利

益的行为。

由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化，量化对冲策略混合型证券投资基金在短期内出现过持有现金与到期日在一年之内的政府债券市值占基金资产净值比低于 5% 的情况。发生此类情况后，该基金均在合理期限内得到了调整，没有给投资人带来额外风险或损失。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年四季度由于股指期货市场的负基差结构仍然存在，不利于对冲策略的操作，因此本基金继续保持低仓位运作。持有的股票部分用于满足申购新股的市值要求，同时对这部分头寸利用股指期货对冲系统性风险。由于新股网下申购的市值要求在不断提高，所以基金的股票仓位也相应增加。闲置资金主要投资于低风险的标的或者现金管理，积极参与新股申购、可转债申购、协议存款、交易所回购等，力争在风险可控的前提下实现净值的稳健增长。未来会密切跟踪期指的情况，在合适的时机加仓。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内基金进行了一次分红，每 10 份分红 1.8 元。截止到报告期末，华宝兴业量化对冲 A 单位净值 1.0098，复权单位净值 1.1901，报告期内累计收益率 0.83%；华宝兴业量化对冲 C 单位

净值 1.0114，复权单位净值 1.1917，报告期内累计收益率 1.83%，同期业绩比较基准收益率为 0.38%，业绩比较基准为一年期银行定期存款利率（税后）。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	79,093,373.02	12.10
	其中：股票	79,093,373.02	12.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	395,010.00	0.06
	其中：债券	395,010.00	0.06
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	190,000,000.00	29.07
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	367,553,791.95	56.23
8	其他资产	16,612,356.36	2.54
9	合计	653,654,531.33	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	602,952.00	0.09
B	采矿业	3,338,715.00	0.51
C	制造业	25,614,057.08	3.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,594,264.66	0.40
E	建筑业	3,529,178.23	0.54
F	批发和零售业	3,725,395.57	0.57
G	交通运输、仓储和邮政业	1,309,562.68	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,912,160.00	0.29

J	金融业	28,083,344.80	4.31
K	房地产业	4,792,403.00	0.74
L	租赁和商务服务业	2,013,720.00	0.31
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,577,620.00	0.24
S	综合	-	-
	合计	79,093,373.02	12.15

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	94,900	3,362,307.00	0.52
2	000625	长安汽车	185,400	2,769,876.00	0.43
3	000001	平安银行	266,400	2,424,240.00	0.37
4	601939	建设银行	445,100	2,421,344.00	0.37
5	600016	民生银行	266,500	2,419,820.00	0.37
6	601166	兴业银行	148,600	2,398,404.00	0.37
7	600000	浦发银行	145,480	2,358,230.80	0.36
8	600015	华夏银行	215,300	2,336,005.00	0.36
9	601211	国泰君安	122,200	2,271,698.00	0.35
10	000686	东北证券	181,300	2,240,868.00	0.34

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	395,010.00	0.06

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	395,010.00	0.06

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	128013	洪涛转债	3,500	395,010.00	0.06

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF1701	IF1701	-79	-78,020,400.00	2,847,540.00	-
公允价值变动总额合计（元）					2,847,540.00
股指期货投资本期收益（元）					-3,920,100.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					2,854,860.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

本基金投资于股指期货，为特殊类型的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，与

股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金的投资符合既定的投资政策和投资目标。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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

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

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

国泰君安（601211）于 2016 年 2 月 16 日收到中国证券监督管理委员会上海监管局《中国证券监督管理委员会上海监管局行政监管措施事先告知书》（沪证监机构字[2016]22 号）。因其场外市

场部做市业务部门的绩效考核体系、内部管理与控制方面等存在重大缺陷，导致 2015 年 12 月 31 日做市股票发生一系列报价异常事件，造成恶劣的市场影响。决定限制其新增做市业务三个月，并责令其在规定时间内，每 3 个月对做市业务部门开展一次内部合规检查，并在每次检查后 10 个工作日内，向上海监管局书面报送合规检查报告。并于 2016 年 2 月 26 日，上海监管局《关于对国泰君安证券股份有限公司采取限制新增做市业务等监管措施的决定》（沪证监决[2016]15 号）。

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

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

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

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

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人对上述股票的投资判断未发生改变。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余七名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	15,636,196.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	704,788.15
5	应收申购款	271,371.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,612,356.36

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝兴业量化对冲混合 A	华宝兴业量化对冲混合 C
报告期期初基金份额总额	439,111,944.23	170,767,556.27
报告期期间基金总申购份额	285,076,933.84	209,143,975.86
减：报告期期间基金总赎回份额	232,297,712.02	227,501,743.92
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	491,891,166.05	152,409,788.21

注：总申购份额含红利再投和转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

7.1.1 基金管理人持有 A 基金份额的变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	11,486,278.15
报告期期间买入/申购总份额	1,750,347.29
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	13,236,625.44
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	2.69

7.1.2 基金管理人持有 C 基金份额的变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	2,779,178.89
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	715,098.15
报告期期末管理人持有的本基金份额	2,064,080.74
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	1.35

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额 (份)	交易金额(元)	适用费率
1	赎回	2016 年 11 月 1 日	-715,098.15	-840,454.86	0.00%
2	红利再投	2016 年 12 月 15 日	1,750,347.29	1,764,000.00	0.00%
合计			1,035,249.14	923,545.14	

注：1、本表交易日期为确认日期，交易金额为确认金额。

2、本表中序号 1 所列示的赎回为 C 份额的赎回，序号 2 所列示的红利再投资为 A 份额。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	15,300,706.18	2.37	9,800,000.00	1.28	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	1,793,686.35	0.28	100,000.00	0.01	不少于 3 年
基金经理等人员	1,148,586.33	0.18	100,000.00	0.01	不少于 3 年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	2,962,274.66	0.46	-	-	-

合计	21,205,253.52	3.29	10,000,000.00	1.31	不少于 3 年
----	---------------	------	---------------	------	---------

注：1、本基金募集期间，本基金管理人运用自有资金、基金管理人高级管理人员及基金经理等人员使用自有资金作为发起资金总计 1,000 万元认购了本基金。发起资金认购的基金份额自基金合同生效之日起持有期不少于 3 年；

2、本基金管理人运用自有资金于 2014 年 9 月 12 日通过本公司直销柜台认购本基金作为发起资金的认购费用为 1,000 元；本基金管理人高级管理人员使用自有资金认购本基金作为发起资金的认购费率为 0.3%；本基金基金经理等人员使用自有资金认购本基金作为发起资金的认购费率为 0.6%。符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
 华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金合同；
 华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金招募说明书；
 华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金托管协议；
 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
 基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
 基金托管人业务资格批件和营业执照。

9.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人住所备投资者查阅。

9.3 查阅方式

投资者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
 2017 年 1 月 19 日