

华宝兴业动力组合混合型证券投资基金
招募说明书摘要（更新）

2017 年第 2 号

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

【重要提示】

本基金根据中国证券监督管理委员会《关于同意华宝兴业动力组合股票型证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2005]162号)和《关于华宝兴业动力组合股票型证券投资基金募集时间的函》(基金部函[2005]240号)的核准,进行募集。基金合同于2005年11月17日正式生效。

基金管理人保证《华宝兴业动力组合混合型证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证投资于本基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资有风险,投资者申购本基金时应认真阅读本基金招募说明书。

本摘要根据《基金合同》和《招募说明书》编写,经基金托管人审核,并经中国证监会核准。《基金合同》是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。投资者自取得依《基金合同》所发售的基金份额,即成为基金份额持有人和《基金合同》当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对《基金合同》的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定享有权利、承担义务;基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅《基金合同》。

本招募说明书摘要所载内容截止日为2017年11月17日,有关财务数据和净值表现截止日为2017年9月30日,财务数据未经审计。

一、 《基金合同》生效日期

本基金自 2005 年 9 月 27 日到 2005 年 11 月 11 日向个人投资者和机构投资者同时发售,《基金合同》于 2005 年 11 月 17 日生效。

二、 基金管理人

(一) 基金管理人概况

基金管理人：华宝基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

法定代表人：孔祥清

总经理：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 Warburg Pincus Asset Management, L.P. 持有 49%的股份。

(二) 主要人员情况

1、董事会成员

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

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

Michael Martin 先生，董事，博士。曾任 Wachtell Lipton Rosen & Katz 律师助理；第一波士顿银行董事总经理；瑞银证券董事总经理；Brooklyn NY Holdings 总裁；现任美国华平投资集团全球执行委员会成员、全球金融行业负责人、董事总经理，美国 Financial Engines 董事、加拿大 DBRS 董事、美国 Mariner Finance 董事。

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

胡光先生，独立董事，硕士。曾任美国俄亥俄州舒士克曼律师事务所律师、飞利浦电子中国集团法律顾问、上海市邦信阳律师事务所合伙人。现任上海胡光律师事务所主任、首席合伙人。

尉安宁先生，独立董事，博士。曾任宁夏广播电视大学讲师，中国社会科学院经济研究所助理研究员，世界银行农业经济学家，荷兰合作银行东北亚区食品农业研究主管，新希望集团常务副总裁，比利时富通银行中国区 CEO 兼上海分行行长，山东亚太中慧集团董事长。现任上海谷旺投资管理有限公司董事长。

陈志宏先生，独立董事，硕士。曾任毕马威会计师事务所合伙人、普华永道会计师事务所合伙人，苏黎世金融服务集团中国区董事长，华彬国际投资（集团）有限公司高级顾问。

2、监事会成员

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

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

贺桂先先生，监事，本科。曾任华宝信托投资有限责任公司研究部副总经理；现任华宝基金管理有限公司营运副总监。

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

3、总经理及其他高级管理人员

孔祥清先生，董事长，简历同上。

HUANG Xiaoyi Helen（黄小蕙）女士，总经理，简历同上。

向辉先生，副总经理，硕士。曾在武汉长江金融审计事务所任副所长、在长盛基金管理有限公司市场部任职。2002 年加入华宝基金管理有限公司参与公司的筹建工作，先后担任公司清算登记部总经理、营运副总监、营运总监，现任华宝基金管理有限公司副总经理。

欧江洪先生，副总经理，本科。曾任宝钢集团财务部主办、宝钢集团成本管理处主管、宝钢集团办公室（董事会办公室）主管/高级秘书、宝钢集团办公厅秘书室主任、华宝投资有限公司总经理助理兼行政人事部总经理、党委组织部部长，党委办公室主任、董事会秘书等职务。现任华宝基金管理有限公司副总经理。

刘月华先生，督察长，硕士。曾在冶金工业部、国家冶金工业局、中国证券业协会等单位工作。现任华宝基金管理有限公司督察长。

4、本基金基金经理

刘自强先生，硕士。2001年7月至2003年7月，在天同证券任研究员，2003年7月至2003年11月，在中原证券任行业研究部副经理，2003年11月至2006年3月，在上海融昌资产管理公司先后任研究员、研究总监。2006年5月加入华宝基金管理有限公司，先后任高级分析师、研究部总经理助理、基金经理助理职务，2008年3月至今任华宝兴业动力组合混合型证券投资基金的基金经理，2010年6月至2012年1月兼任华宝兴业宝康消费品证券投资基金基金经理，2012年4月起任投资副总监，2014年12月起兼任华宝兴业高端制造股票型证券投资基金基金经理，2015年5月起兼任华宝兴业国策导向混合型证券投资基金基金经理，2016年11月任华宝兴业未来主导产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

本基金的历任基金经理为史伟先生，其管理本基金的时间为2005年11月至2008年3月。

5、投资决策委员会成员

刘自强先生，投资总监、华宝兴业动力组合混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业高端制造股票型证券投资基金基金经理、华宝兴业国策导向混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业未来主导产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

闫旭女士，投资总监、国内投资部总经理、华宝兴业行业精选混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、华宝兴业智慧产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

胡戈游先生，助理投资总监、华宝兴业宝康消费品证券投资基金基金经理、华宝兴业品质生活股票型证券投资基金基金经理、华宝兴业核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

曾豪先生，研究部总经理。

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

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

(三) 基金管理人职责

基金管理人应严格依法履行下列职责：

1、 依法募集本基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、 办理本基金备案手续；

- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季报、半年报和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、中国证监会规定的其他职责。

(四) 基金管理人承诺

1、基金管理人将遵守《基金法》、《证券法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行为的发生。

2、基金管理人不得从事下列行为：

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金经理承诺

- (1) 依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- (2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；
- (3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(五) 基金管理人内部控制制度

1、风险管理体系

本基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规性风险、信誉风险和事件风险（如灾难）。

针对上述各种风险，本公司建立了一套完整的风险管理体系，具体包括以下内容：

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

(2) 识别风险。辨识公司运作和基金管理中存在的风险。

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

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

(5) 处理风险。将风险水平与既定的标准相对比，对于那些级别较低、在公司所定标准范围以内的风险，控制相对宽松一点，但仍加以定期监控，以防其超过预定标准；而对较为严重的风险，则制定适当的控制措施；对于一些后果可能极其严重的风险，则除了严格控制以外，还准备了相应的应急处理措施。

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

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

2、内部控制制度

(1) 内部风险控制原则

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

有效性原则。通过设置科学清晰的操作流程，结合程序控制，建立合理的内控程序，保证内部控制制度的有效执行。

独立性原则。公司必须在精简高效的基础上设立能充分满足公司经营运作需要的部门和岗位，各部门和岗位在职能上保持相对独立性；公司固有财产、各项委托基金财产、其他资产分离运作，独立进行。

相互制约原则。内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制约，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点。

防火墙原则。公司基金管理、交易、清算登记、信息技术、研究、市场开发等相关部门，应当在物理上和制度上适当隔离；对因业务需要必须知悉内幕信息的人员，应制定严格的批准程序和监督防范措施。

成本效益原则。公司应当充分发挥各部门及每位员工的工作积极性，尽量降低经营运作成本，

保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

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

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

审慎性原则。公司内部的核心是风险控制，内部控制制度的制订要以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

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

（2）内部风险控制的要求和内容

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

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

（3）督察长制度

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

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

（4）监察稽核及风险管理制度

监察稽核部和风险管理部依据公司的内部控制制度，在所赋予的权限内，按照所规定的程序和适当的方法，进行公正客观的检查和评价。

监察稽核部和风险管理部负责调查评价公司内控制度的健全性、合理性；负责调查、评价公司有关部门执行公司各项规章制度的情况；评价各项内控制度执行的有效性，对内控制度的缺失提出补充建议；进行日常风险监控工作；协助评价基金财产风险状况；负责包括基金经理离任审查在内的各项内部审计事务等。

3、基金管理人关于内部合规控制声明书

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

三、 基金托管人

(一) 基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：陈四清

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：(010) 66594942

中国银行客服电话：95566

(二) 基金托管部门及主要人员情况

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

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

(三) 证券投资基金托管情况

截至2017年09月30日，中国银行已托管637只证券投资基金，其中境内基金600只，QDII基金37只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

(四) 托管业务的内部控制制度

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

2007年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

四、 相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构：

（1）直销柜台

本公司在上海开设直销柜台。

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心58楼

邮政编码：200120

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

直销柜台传真：021-50499663、50988055

（2）直销e网金

投资者可以通过本公司直销e网金网上交易系统办理本基金的申购、赎回、转换等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。直销e网金网址：www.fsfund.com。

2、代销机构：

（1）中国工商银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号

客户电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

(2) 中国农业银行股份有限公司

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

客户电话：95599

公司网址：www.95599.cn

(3) 中国银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼

客户电话：95566

公司网址：www.boc.cn

(4) 中国建设银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

客户电话：95533

公司网址：www.ccb.com

(5) 交通银行股份有限公司

办公地址：上海市银城中路 188 号

联系人：曹榕

联系电话：(021) 58781234

传真：(021) 58408483

客户电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

(6) 招商银行股份有限公司

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

联系人：邓炯鹏

联系电话：0755-83198888

客户电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

(7) 兴业银行股份有限公司

客户电话：95561 或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址：<http://www.cib.com.cn>

(8) 中国民生银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

联系人：杨成茜

联系电话：010-58560666

传真：010-57092611

客户电话：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

(9) 渤海银行股份有限公司

办公地址：天津市河东区海河东路 218 号渤海银行大厦

客户电话：95541

公司网址：www.cbhb.com.cn

(10) 广发银行股份有限公司

办公地址：广东省广州市农林下路 83 号

客户电话：800-830-8003；400-830-8003

公司网址：www.gdb.com.cn

(11) 华夏银行股份有限公司

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

客户电话：95577

公司网址：www.hxb.com.cn

(12) 江苏银行股份有限公司

客户电话：96098，40086-96098

公司网址：www.jsbchina.cn

(13) 平安银行股份有限公司

联系人：张莉

联系电话：021-38637673

传真：021-50979507

客户电话：95511-3

公司网址：bank.pingan.com

(14) 上海浦东发展银行股份有限公司

联系人：高天、姚磊

联系电话：021-61618888

传真：021-63604196

客户电话：95528

公司网址：www.spdb.com.cn

（15）中信银行股份有限公司

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街9号

联系人：陈国媚

客户电话：95558

公司网址：bank.ecitic.com

（16）安信证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1号楼9层

法定代表人：牛冠兴

联系人：杨天枝

联系电话：0755-82558323

传真：0755-82558355

客户电话：4008-001-001

公司网址：www.essence.com.cn

（17）渤海证券股份有限公司

办公地址：天津市南开区云际道立达公寓F座渤海证券

法定代表人：王春峰

联系人：王星

联系电话：022-28451922

客户电话：4006515988

公司网址：www.ewww.com.cn

（18）长城证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16-17层

法定代表人：丁益

联系人：金夏

联系电话：0755-83516289

客户电话：400-6666-888

公司网址: www.cgws.com/cczq/

(19) 长江证券股份有限公司

办公地址: 湖北省武汉市新华路特 8 号

法定代表人: 尤习贵

联系人: 奚博宇、黄美慧

联系电话: 021-68751860; 027-65799827

客户电话: 95579 或 4008-888-999

公司网址: www.95579.com

(20) 北京创金启富投资管理有限公司

办公地址: 北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

联系人: 李婷婷

联系电话: 010-66154828-8038

传真: 010-63583991

客户电话: 400-6262-818

公司网址: www.5irich.com

(21) 北京蛋卷基金销售有限公司

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

法定代表人: 钟斐斐

联系电话: 010-61840688

传真: 010-61840699

客户电话: 4000618518

公司网址: <https://danjuanapp.com/>

(22) 德邦证券股份有限公司

办公地址: 上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人: 姚文平

联系人: 刘熠

联系电话: 68761616-8076

传真: 862168767981

客户电话: 400-8888-128

公司网址: www.tebon.com.cn

(23) 东北证券股份有限公司

办公地址：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

联系人：付静雅

联系电话：0431-82006251

传真：0431-85096795

客户电话：95360

公司网址：www.nesc.cn

(24) 东方证券股份有限公司

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

法定代表人：潘鑫军

联系人：黄静

联系电话：63325888-3137

传真：021-63326729

客户电话：95503

公司网址：www.dfzq.com.cn

(25) 东海证券股份有限公司

办公地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

法定代表人：朱科敏

联系人：王一彦

联系电话：20333910

传真：021-50498871

客户电话：95531

公司网址：www.longone.com.cn

(26) 东吴证券股份有限公司

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

联系人：陆晓

联系电话：0512-62938521

传真：0512-65588021

客户电话：95330

公司网址：www.dwzq.com.cn

(27) 东兴证券股份有限公司

联系人：汤漫川

联系电话：010-66555316

传真：010-66555246

客户电话：400-8888-993

公司网址：www.dxzq.net.cn

(28) 方正证券股份有限公司

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：何其聪

联系人：齐冬妮

联系电话：010-59355807

客户电话：95571

公司网址：www.foundersc.com

(29) 光大证券股份有限公司

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号 3 楼

法定代表人：薛峰

联系人：李晓哲、姚巍、李芳芳

联系电话：021-22169111、021-22169502

传真：021-22169134

客户电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

(30) 广发证券股份有限公司

办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 18 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

联系电话：020-87555888-8333

客户电话：95575 或致电各地营业网点

公司网址：www.gf.com.cn

(31) 国都证券股份有限公司

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层

法定代表人：王少华

联系人：李弢

联系电话：010-84183331

客户电话：400-818-8118

公司网址：www.guodu.com

(32) 中国国际金融股份有限公司

联系人：罗春蓉、陈曦、康楠

联系电话：010-65051166

传真：010-65058065

客户电话：400-910-1166

(33) 国泰君安证券股份有限公司

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

法定代表人：杨德红

联系人：钟伟镇

联系电话：38032284

传真：021-38670666

客户电话：95521、4008888666

公司网址：www.gtja.com

(34) 国信证券股份有限公司

办公地址：深圳市红岭中路1012号国信证券大厦

法定代表人：何如

联系人：李颖

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

传真：0755-82133952

客户电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

(35) 国元证券股份有限公司

客户电话：4008888777 或 95578

公司网址: www.gyzq.com.cn

(36) 海通证券股份有限公司

办公地址: 上海广东路 689 号

法定代表人: 周杰

联系人: 李楠、涂洋

联系电话: 23219061、23219290

客户电话: 95553

公司网址: www.htsec.com

(37) 上海好买基金销售有限公司

办公地址: 上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

联系人: 陆敏

联系电话: 021-20613600

传真: 021-68596919

客户电话: 400-700-9665

公司网址: www.ehowbuy.com

(38) 和讯信息科技有限公司

办公地址: 北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

联系人: 刘洋

联系电话: 021-20835879

传真: 021-20835788

客户电话: 400-920-0022

公司网址: www.licaike.com

(39) 恒泰证券股份有限公司

办公地址: 内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

联系人: 王旭华

联系电话: 0471-4972343

客户电话: 400-196-6188

公司网址: www.cnht.com.cn

(40) 申万宏源西部证券有限公司

办公地址: 新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：李季

联系人：黄莹

联系电话：021-33388211

传真：0991-2301927

客户电话：400-800-0562

公司网址：www.swhysc.com

(41) 华安证券股份有限公司

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座 0327 室

法定代表人：李工

联系人：樊忠亚

联系电话：0551-65161675

传真：0551-65161672

客户电话：95318

公司网址：www.hazq.com

(42) 华宝证券有限责任公司

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 楼

法定代表人：陈林

联系人：胡星煜

联系电话：20515583

传真：021-20515593

客户电话：400-820-9898, 021-38929908

公司网址：www.cnhbstock.com

(43) 华宝直销

联系电话：021-38505888-731/732

(44) 华福证券有限责任公司

联系电话：0591-96326

客户电话：96326（福建省外请加拨 0591）

公司网址：www.hfzq.com.cn

(45) 华泰证券股份有限公司

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

联系电话：0755-82492193

客户电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

(46) 江海证券有限公司

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

联系人：周俊

联系电话：0451-85863726

传真：0451-82337279

客户电话：400-666-2288

公司网址：www.jhzq.com.cn

(47) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

联系人：文雯

联系电话：010-83363010

传真：010-83363099

客户电话：400-166-1188

公司网址：<http://8.jrj.com.cn>

(48) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

办公地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

联系人：赵德赛

联系电话：4000988511

传真：010-89188000

客户电话：4000988511

公司网址：<http://kenterui.jd.com>

(49) 上海联泰资产管理有限公司

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

联系人：兰敏

联系电话：021-52822063

传真：021-52975270

客户电话：4000-466-788

公司网址：www.66zichan.com

(50) 上海陆金所资产管理有限公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

联系人：程晨

联系电话：021-20665952

传真：021-50783597

客户电话：4008219031

公司网址：www.lufunds.com

(51) 民生证券有限责任公司

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

联系人：赵明

联系电话：010-85127622

传真：010-85127917

客户电话：400-619-8888

公司网址：www.msza.com

(52) 中国民族证券有限责任公司

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40F-43F

法定代表人：何亚刚

联系人：齐冬妮

联系电话：010-59355807

客户电话：4008895618

公司网址：www.e5618.com

(53) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

办公地址：上海杨浦区秦皇岛路 32 号 C 栋 2 楼

联系人：方成

联系电话：021-38609777

客户电话：400-821-5399

公司网址: www.noah-fund.com

(54) 平安证券股份有限公司

办公地址: 深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人: 曹实凡

联系人: 周一涵

联系电话: 021-38637436

传真: 0755-82435367

客户电话: 95511-8

公司网址: www.stock.pingan.com

(55) 山西证券股份有限公司

办公地址: 山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人: 侯巍

联系人: 韩笑

联系电话: 0351-8686656

传真: 0351-8686619

客户电话: 95573

公司网址: www.i618.com.cn

(56) 上海证券有限责任公司

办公地址: 上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人: 李俊杰

联系人: 邵珍珍

联系电话: 021-53686262

传真: 021-53686100, 021-53686200

客户电话: 4008918918、021-962518

公司网址: www.962518.com

(57) 申万宏源证券有限公司

办公地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 40 楼

法定代表人: 李梅

联系人: 黄莹

联系电话: 021-33388211

传真：021-33388224

客户电话：95523、4008895523

公司网址：www.swhysc.com

(58) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F

联系人：韩爱彬

联系电话：021-60897840

传真：0571-26697013

客户电话：4000-776-123

公司网址：<http://www.fund123.cn/>

(59) 深圳腾元基金销售有限公司

办公地址：深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806-1810

联系人：鄢萌莎

联系电话：0755-33376922

客户电话：4006-877-899

公司网址：www.tenyuanfund.com

(60) 上海天天基金销售有限公司

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼

联系人：杨蕾

联系电话：021-54509998

传真：021-64385308

客户电话：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

(61) 浙江同花顺基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

联系人：董一锋

联系电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

客户电话：4008-773-772

公司网址：www.5ifund.com

(62) 上海万得投资顾问有限公司

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

联系电话：021-51327185

传真：021-6888 2281

客户电话：400-821-0203

(63) 北京新浪仓石基金销售有限公司

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

联系人：付文红

联系电话：010-62675979

传真：010-62675369

客户电话：010-62675369

公司网址：www.xincai.com

(64) 信达证券股份有限公司

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：尹旭航

联系电话：010-63081493

客户电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

(65) 兴业证券股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦

法定代表人：兰荣

联系人：乔琳雪、吴嘉虹

联系电话：021-38565547、021-38565570

客户电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

(66) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

联系人：宋欣怡

联系电话：010-52855713

传真：010-85894285

客户电话：400-6099-200

公司网址：www.yixinfund.com

（67）中国银河证券股份有限公司

办公地址：中国北京西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈共炎

联系人：辛国政； 邓颜

联系电话：010-83574507； 010-66568292

传真：010-66568990

客户电话：95551、400-8888-888

公司网址：www.chinastock.com.cn

（68）招商证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 39—45 层

法定代表人：宫少林

联系人：黄婵君

联系电话：86-755-82960167

客户电话：4008895565 或 95565

公司网址：www.newone.com.cn

（69）中经北证（北京）资产管理有限公司

办公地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼 1 层

联系人：陶涛

联系电话：010-68292745

传真：010-68292941

客户电话：400-600-0030

公司网址：www.bzfund.com

（70）中泰证券股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 18 层

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

联系电话：021-20315290

客户电话：95538

公司网址：www.zts.com.cn

（71）中国中投证券有限责任公司

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

法定代表人：高涛

联系人：张鹏

联系电话：0755-82023442

客户电话：95532 或 400 600 8008

公司网址：www.china-invs.cn

（72）中信建投证券股份有限公司

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：许梦园

联系电话：010-85156398

客户电话：400-8888-108、95587

公司网址：www.csc108.com

（73）中信期货有限公司

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

联系人：洪诚

联系电话：0755-23953913

传真：0755-83217421

客户电话：400-990-8826

公司网址：www.citicsf.com

（74）中信证券股份有限公司

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：马静懿

联系电话：010-60833889

传真：010-6083 6029

客户电话：95548

公司网址：www.cs.ecitic.com

(75) 中信证券（山东）有限责任公司

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

联系人：赵艳青

联系电话：0532-85023924

传真：0532-85022605

客户电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

(76) 中银国际证券有限责任公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 31 楼

法定代表人：宁敏

联系人：许慧琳

联系电话：021-20328531

传真：021-50372474

客户电话：400-620-8888

公司网址：www.bocichina.com

(77) 深圳众禄金融控股股份有限公司

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

联系人：童彩平

联系电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

客户电话：400-678-8887

公司网址：www.zlfund.cn

(78) 珠海盈米财富管理有限公司

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

联系人：李孟军

联系电话：020-89629066

传真：020-89629011

客户电话：020-89629099

公司网址：www.yingmi.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求选择其他机构代理销售基金，并及时公告。

（二） 登记机构：华宝基金管理有限公司（同上）

（三） 律师事务所和经办律师

名称：通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：韩炯

联系电话：(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：曹阳

经办注册会计师：薛竞、曹阳

五、 基金简介

基金名称：华宝兴业动力组合混合型证券投资基金

基金类型：契约型开放式基金

六、 基金的投资

（一） 投资目标

通过对基金组合的动态优化管理，使基金收益持续稳定超越比较基准，并追求单位风险所获得

的超额收益最大化。

（二）投资理念

本基金认为股票的预期收益由“价值因子”和“成长因子”共同驱动，不同阶段二者对股票预期收益的驱动作用不同，把握其变动趋势，自下而上精选个股，可以增加超额收益（ α 值）。

（三）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，主要包括国内依法发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。

（四）投资策略

本基金根据中国股市价值驱动因子与成长驱动因子的变动趋势，调整评估个股“价值因子”与“成长因子”的权重比例，自下而上精选个股，获取超额收益。

在正常的市场情况下，本基金的投资比例范围为：股票占基金资产净值的60%—95%；债券占0%—40%，现金或者到期日在一年内的政府债券比例在5%以上。

1、股票投资策略

（1）自下而上精选个股策略

本基金认为股票的预期收益由价值因子和成长因子共同驱动。在个股精选过程中将精选指标分为“价值因子”和“成长因子”，个股的价值指标和成长指标都经过行业、公司规模调整，给予标准化评分。

（2）动态优化策略

本基金基于对中国股票市场历史数据的统计研究，发现“价值因子”和“成长因子”在不同阶段对股票预期收益的驱动作用不尽相同，且某一因子的驱动作用具有短期趋势特征。通过跟踪近期价值因子与成长因子对股票预期收益驱动作用的发展趋势，确定当期个股“价值因子”和“成长因子”得分的权重，从而得出当期个股综合得分并进行排名。

本基金将重点投资得分排名靠前的股票，并结合本公司股票投资研究平台，对股票价格逐一评估，确定其是否具有投资价值。同时考虑个股对投资组合的边际风险贡献度、个股的流动性等因素，调整个股投资比例，实现组合优化。

（3）自上而下驱动的行业配置策略

投资组合的目标行业配置比例为由个股得分排名靠前的股票组合形成的行业配置比例。

2、债券投资策略

（1）本基金债券投资的主要目的是为了回避特定时期股票投资可能存在的风险，同时获取债券投资的收益；

(2) 本基金投资债券将采取稳健的投资策略。

3、权证投资策略

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

(五) 业绩比较基准

本基金的股票投资部分的业绩比较基准采用 80%上证 180 指数收益率与深证 100 指数收益率的流通市值加权平均值，债券投资部分的业绩比较基准采用上证国债指数收益率。本基金定位为混合型基金，债券投资只是为了回避特定时期股票投资可能存在的风险；根据本基金的投资比例范围，本基金的业绩比较基准为：

80%上证 180 指数收益率与深证 100 指数收益率的流通市值加权平均+20%上证国债指数收益率。

(六) 投资程序

1、投资决策委员会负责投资决策

投资决策委员会定期和不定期召开会议，负责就基金重大战略、资产配置、价值/成长权重配比策略的调整做出决策。

2、量化投资部负责跟踪数量分析模型

量化投资部实时跟踪数量分析模型，定期将股票排名结果提交给研究部和基金经理，定期判断价值/成长权重配比策略是否符合市场特征。

3、研究部负责投资研究和分析

宏观研究人员通过研究其他证券公司和基金管理公司的报告，通过走访政府决策部门和研究部门，研究经济形势、经济政策（货币政策、财政政策、区域政策、产业政策等）、重大技术发明等，撰写宏观研究报告，就基金的股票、债券、现金比例提出建议。

行业研究人员根据量化投资部定期提交的股票排名，以排名前 50%的股票为基准库，考察上市公司的核心业务竞争力、经营能力和公司治理结构等，预测上市公司未来 2—3 年的经营情况，选择重点上市公司进行调研，撰写行业和子行业研究报告及上市公司调研报告，对个股买卖提出具体建议。

4、基金经理小组负责投资执行

基金经理小组根据宏观经济和行业发展，结合量化分析等工具对股市做出判断，提出投资组合的资产配置比例建议，同时结合数量分析模型的股票排序和研究员的报告，形成投资计划提交投资决策委员会，并根据投资决策委员会的决策，具体实施投资计划。

经投资决策委员会和总经理审核投资组合方案后，基金经理向交易部下达具体的投资指令，交易员根据投资决定书执行指令。

5、绩效评估

主要包括四项核心功能：风格检验、风险评估、投资绩效的风险调整和业绩贡献，由绩效评估人员利用相关工具评估。

6、内部控制

内部控制委员会、督察长、副总经理、风险管理部负责内控制度的制定，并检查执行情况。

（七）基金投资限制

1、组合限制

- （1）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- （2）本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；
- （3）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过基金总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- （4）本基金资产总值不超过本基金资产净值的 140%；
- （5）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的千分之五；
- （6）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的百分之三；
- （7）本公司管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的百分之十；
- （8）法律法规和基金合同规定的其他限制。

2、如果法律法规对基金合同约定的投资禁止行为和投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。

3、投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

4、禁止行为

本基金禁止从事下列行为：

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；

(4) 买卖其他基金份额，但是法律法规另有规定的除外；

(5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

(6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；但有关监管机构允许的情况除外；

(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(8) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

(八) 基金管理人代表基金行使股东权利的原则及方法

1、不谋求对上市公司的控股，不参与上市公司的经营管理；

2、有利于基金财产的安全与增值；

3、独立行使股东权利，保护基金投资者的利益；

4、基金管理人按照有关规定代表基金出席上市公司股东大会，行使股东权利，履行股东义务。

七、 基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至 2017 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,357,795,684.72	85.46
	其中：股票	1,357,795,684.72	85.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	82,135,288.21	5.17
	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	146,598,141.42	9.23
8	其他资产	2,275,246.41	0.14
9	合计	1,588,804,360.76	100.00

2、 报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	16,019,793.60	1.05
C	制造业	574,466,945.70	37.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,227,565.49	0.34
E	建筑业	24,501,162.08	1.61
F	批发和零售业	28,363,722.08	1.86
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.00
J	金融业	627,193,915.74	41.24
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,851,464.05	5.38
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.01
R	文化、体育和娱乐业	12,776.05	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,357,795,684.72	89.27

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002126	银轮股份	4,900,000	48,755,000.00	3.21
2	600999	招商证券	2,199,916	47,056,203.24	3.09
3	000776	广发证券	2,449,916	46,499,405.68	3.06
4	601688	华泰证券	2,050,000	46,371,000.00	3.05
5	601211	国泰君安	2,100,000	45,423,000.00	2.99
6	601628	中国人寿	1,599,916	44,381,669.84	2.92

7	000783	长江证券	4,499,944	43,829,454.56	2.88
8	002449	国星光电	2,250,000	43,312,500.00	2.85
9	300070	碧水源	2,400,000	43,224,000.00	2.84
10	601328	交通银行	6,600,000	41,712,000.00	2.74

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

(3) 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

(1) 动力组合基金截至 2017 年 9 月 30 日持仓前十名证券中的招商证券 (600999) 于 2017 年 4 月 28 日收到深圳证监局整改通知。由于公司在为客户开立 PB 系统账户的时候, 对客户的尽职调查不完整, 违反了《证券公司监督管理条例》的有关规定。现决定对公司采取责令改正并暂停新开立 PB 系统账户 3 个月的行政监管措施。同时要求公司应对 PB 系统相关业务开展情况进行全面自查, 并自收到决定书之日起 30 日内向深圳证监局提交自查整改报告。

动力组合基金截至 2017 年 9 月 30 日持仓前十名证券中的广发证券 (000776) 于 2016 年 11 月 24 日收到中国证券监督管理委员会辽宁监管局整改通知。因公司营口学府路证券营业部在代销宝盈新动力 3、7、15 号产品过程中, 未能全面、公正、准确地介绍金融产品有关信息, 充分说明金融产品的主要风险特征, 未能保证金融产品营销人员充分了解所负责推介金融产品的信息, 营业部在产品销售过程中的风险揭示不到位, 对广发证券股份有限公司营口学府路证券营业部采取责令改正的措施。

广发证券 (000776) 于 2016 年 11 月 28 日收到中国证监会处罚决定。因公司在未采集上述客户身份识别信息的情况下, 未实施有效的了解客户身份的回访、检查等程序。对广发证券责令改正, 给予警告, 没收违法所得 6,805,135.75 元, 并处以 20,415,407.25 元罚款。

动力组合基金截至 2017 年 9 月 30 日持仓前十名证券中的华泰证券 (601688) 于 2017 年 1 月 20 日收到中国证券监督管理委员会整改通知。因公司营业部及资产管理子公司分别利用同名微信公众号、官方网站向不特定对象公开宣传推介私募资产管理产品, 违反相关法规。决定对公司采取责令改正的行政监管措施。

华泰证券 (601688) 于 2017 年 3 月 28 日收到全国中小企业股份转让系统整改通知。因华泰证券作为主办券商未核实对禹州源衡水处理有限公司《行政处罚决定书》的内容差异, 导致公开转让说明书披露的处罚金额为叁万元整与上述《行政处罚决定书》金额不符。现决定华泰证券股份有限公司采取要求提交书面承诺的自律监管措施。

华泰证券 (601688) 于 2017 年 3 月 28 日收到全国中小企业股份转让系统整改通知。因华泰证券未勤勉履行补充核查义务, 现决定华泰证券股份有限公司采取要求提交书面承诺的自律监管措施。

华泰证券 (601688) 于 2017 年 4 月 7 日收到全国中小企业股份转让系统整改通知。因华泰证券未能在知悉或者应当知悉挂牌公司发生违规对外担保之日起十五个转让日内对其进行现场检查, 违反了《全国中小企业股份转让系统主办券商持续督导工作指引 (试行)》, 未能勤勉尽责地履行持续督导义务。现决定华泰证券股份有限公司采取要求提交书面承诺的自律监管措施。

华泰证券 (601688) 于 2017 年 6 月 13 日收到天津证监局警告。因华泰证券营业部员工刘某蕾

代客户在《融资融券交易风险揭示书》上抄写“以上《融资融券交易风险揭示书》的全部内容，本人确认已阅读并完全理解，愿意承担融资融券交易的风险和损失”的内容。决定对营业部采取出具警示函的监督管理措施。

动力组合基金截至 2017 年 9 月 30 日持仓前十名证券中的国泰君安（601211）于 2016 年 12 月 27 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。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和视为，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人对上述股票的投资判断未发生改变。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余六名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

（2）基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	819,368.41
2	应收证券清算款	139,100.02
3	应收股利	-
4	应收利息	52,144.80
5	应收申购款	1,264,633.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,275,246.41

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

八、 基金的业绩

基金业绩截止日为 2017 年 9 月 30 日。基金过往业绩不代表未来表现，本报告中所列数据未经审计。

1、 净值增长率与同期比较基准收益率比较

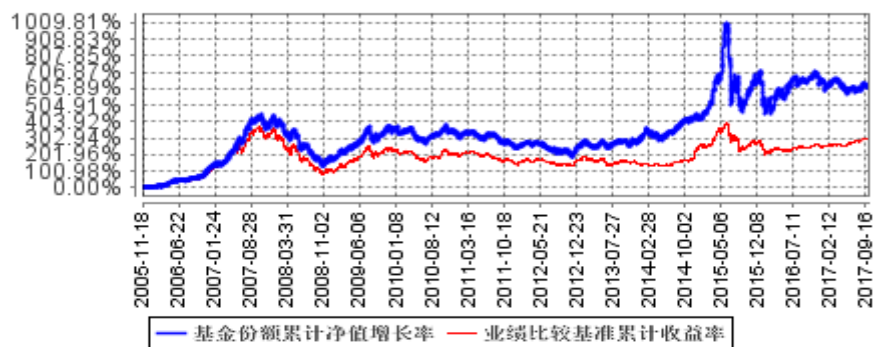
阶段	净值增长率 ①	净值增长率标准差 ②	业绩比较基准收益率 ③	业绩比较基准收益率标准差 ④	①—③	②—④
2005/11/17-2005/12/31	2.64%	0.20%	6.19%	0.63%	-3.55%	-0.43%
2006/01/01-2006/12/31	117.73%	1.08%	92.16%	1.13%	25.57%	-0.05%
2007/01/01-2007/12/31	129.41%	1.82%	117.16%	1.84%	12.25%	-0.02%
2008/01/01-2008/12/31	-47.54%	2.14%	-55.80%	2.43%	8.26%	-0.29%
2009/01/01-2009/12/31	73.56%	1.55%	73.25%	1.65%	0.31%	-0.10%
2010/01/01-2010/12/31	-5.46%	1.19%	-10.29%	1.26%	4.83%	-0.07%
2011/01/01-2011/12/31	-21.11%	0.90%	-19.13%	1.05%	-1.98%	-0.15%
2012/01/01-2012/12/31	1.24%	1.22%	8.63%	1.02%	-7.39%	0.20%
2013/01/01-2013/12/31	11.18%	1.34%	-5.77%	1.13%	16.95%	0.21%
2014/01/01-2014/12/31	31.82%	1.29%	43.61%	0.99%	-11.79%	0.30%
2015/01/01-2015/12/31	54.79%	2.64%	5.01%	1.98%	49.78%	0.66%
2016/01/01-2016/12/31	-5.87%	2.03%	-7.75%	1.12%	1.88%	0.91%
2017/01/01-2017/09/30	-4.46%	0.87%	12.92%	0.45%	-17.38%	0.42%
2005/11/18-2017/09/30	619.05%	1.60%	295.86%	1.45%	323.19%	0.15%

2、基金累计净值增长率与比较基准收益率走势对比

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2005年11月17日至2017年9月30日)

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2006年3月31

日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

九、 基金份额的申购和赎回

（一）基金份额申购和赎回的场所

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

投资者可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。具体办法另行公告。

（二）申购与赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

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

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所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时间进行相应的调整并公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金自 2005 年 12 月 19 日起开始办理日常申购、赎回业务。

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。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的，视同下次开放时间提交的申请。

（三）申购与赎回的原则

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

2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

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

4、当日的申购与赎回申请可以在当日交易时间结束前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；

5、基金的申购和赎回以书面或经基金管理人认可的其他方式进行；

6、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前三个工作日予以公告。

（四） 申购与赎回的程序

1、 申购和赎回的申请方式

基金投资者须按基金管理人和销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出申购或赎回的申请。

投资者提交申购申请时，须按销售机构规定的方式备足申购资金。

投资者提交赎回申请时，在其提出赎回申请的销售机构（网点）交易账号内必须有足够的基金份额余额。

2、 申购和赎回申请的确认

基金管理人应以在基金申购、赎回的交易时间段内收到申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），并在T+1日对该交易的有效性进行确认。投资者可在T+2日及之后到其提出申购与赎回申请的网点进行成交查询。

3、 申购和赎回的款项支付

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

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立。登记机构确认赎回时，赎回生效。

投资者赎回申请成功后，赎回款项在自成交确认日起五个工作日内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金合同有关规定处理。

（五） 申购与赎回的数额限制

1、 申请申购基金的数额限制

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者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。

代销网点的投资者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。投资者可多次申购，对单个投资者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、 申请赎回基金的数额限制

投资者可将其全部或部分基金份额赎回。本基金按照份额进行赎回，申请赎回份额精确到小数点后两位，单笔赎回份额不得低于 100 份。基金持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足 100 份的，在赎回时需一次全部赎回。

基金管理人可根据市场情况调整上述申购与赎回的规定，但应最迟在调整生效前三个工作日在至少一种指定媒介予以公告。

（六）基金的申购费和赎回费

1、基金的申购费

（1）基金申购费率表如下：

申购金额	申购费率
500 万（含）以上	每笔 1000 元
大于等于 200 万，小于 500 万	0.5%
大于等于 100 万，小于 200 万	1.0%
大于等于 50 万，小于 100 万	1.2%
50 万以下	1.5%

投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。本基金的申购费用由申购人承担，主要用于市场推广、销售、登记等各项费用，不列入基金财产。

2、基金的赎回费

（2）赎回费随基金持有时间的增加而递减，费率如下：

持有时间	费率
两年以内（含两年）	0.5%
两年—三年（含三年）	0.3%
三年以上	0%

本基金的赎回费用由赎回人承担，其中 25% 的部分归入基金财产，其余部分用于支付登记费等相关手续费。

（七）申购份额与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算：

本基金将采用外扣法计算申购费用及申购份额。其中，

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / [1 + \text{申购费率}]$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

申购费用、净申购金额的计算按四舍五入方法，保留到小数点后两位。申购份额的计算结果保留小数点后两位，两位以后舍去，舍去部分所代表的资产归基金财产所有。

2、赎回金额的计算

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

赎回总额=赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额－赎回费用

赎回总额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额，赎回金额为赎回总额扣除相应的费用。赎回总额保留小数点后两位，小数点两位以后的部分舍去，舍去部分代表的资产归基金财产所有。

3、T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金份额总额。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

（八）申购与赎回的注册、变更登记

1、基金投资者提出的申购和赎回申请，在当日交易时间结束之前可以撤销。

2、投资者申购基金成功后，基金登记机构在T+1日为投资者增加权益并办理登记手续，投资者自T+2日起有权赎回该部分基金份额。

3、投资者赎回基金成功后，基金登记机构在T+1日为投资者扣除权益并办理相应的登记手续。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前三个工作日在指定媒介予以公告。

（九）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

（1）因不可抗力导致基金管理人无法接受投资者的申购申请；

（2）证券交易所交易时间非正常停市；

（3）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

（4）基金财产规模过大，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的利益的情形；

（5）基金管理人认为某笔申购会有损于现有基金份额持有人利益；

（6）法律法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退划给投资者。

基金管理人拒绝或暂停接受申购的方式包括：

- (1) 拒绝接受、暂停接受某笔或某数笔申购申请；
- (2) 拒绝接受、暂停接受某个或某数个工作日的全部申购申请；
- (3) 按比例拒绝接受、暂停接受某个或某数个工作日的申购申请。

2、在如下情况下，基金管理人可以拒绝接受或暂停接受投资者的赎回申请：

- (1) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；
- (2) 证券交易所交易时间非正常停市；
- (3) 发生巨额赎回，根据基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；
- (4) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- (5) 法律法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

发生上述情形之一的，已经确认的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以支付。

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。

3、发生基金合同、招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停接受基金申购、赎回申请的，报经中国证监会批准后可以暂停接受投资者的申购、赎回申请。

4、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

5、暂停期间结束，基金重新开放时，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

(1) 如果发生暂停的时间为一天，基金管理人将于重新开放日，在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最新的基金份额净值。

(2) 如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前一个工作日，在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

(3) 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，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前三个工作日，在指定媒介连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

(十) 巨额赎回的认定及处理方式

1、巨额赎回的认定

单个开放日基金净赎回申请超过上一日基金总份额的 10%时，为巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受全额赎回或部分延期赎回。

(1) 接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个账户当日办理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，自动延迟至下一开放日办理赎回。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权并将以下一个开放日的基金份额净值为准进行计算，以此类推，直到全部赎回为止。

(3) 当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应在三个工作日内通过指定媒介、基金管理人公司网站或代销机构的网点刊登公告，说明有关处理方法。

3、连续发生巨额赎回的处理方式

本基金连续两个开放日以上（含两日）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经确认的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过支付时间二十个工作日，并应当在指定媒介公告。

十一、基金的费用

(一) 与基金运作有关的费用

1、费用种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 基金的证券交易费用；
- (4) 基金合同生效以后的信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金合同生效以后与基金相关的会计师费和律师费；
- (7) 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

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

2、费率水平、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.5% 年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

(2) 基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

(3) 本条第 1 款第 (3) 至第 (7) 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，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。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

4、基金管理人和基金托管人可协商酌情调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会，但应报经中国证监会批准。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前三个工作日在至少一种指定媒介上刊登公告。

(二) 与基金销售有关的费用

本基金的申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“八、

基金份额的申购与赎回”中的“（六）基金的申购费和赎回费”中的相关规定。本基金与公司管理的其它基金间的转换费率、计算公式、转换程序请详见本招募说明书“九、与基金管理人管理的其他基金转换”中的相关规定。

十二、《招募说明书》更新部分的说明

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）及其他有关规定，华宝基金管理有限公司对《华宝兴业动力组合混合型证券投资基金招募说明书》作如下更新：

- 1、“三、基金管理人”更新了基金管理人的相关信息。
- 2、“四、基金托管人”更新了基金托管人的相关信息。
- 3、“五、相关服务机构”更新了“一、基金份额发售机构”中代销机构的相关信息。
- 4、“九、与基金管理人管理的其他基金转换”更新了本基金办理转换业务的销售机构及本基金与其他基金转换的相关信息。
- 5、“十、基金的投资”更新了截至2017年9月30日的基金的投资组合报告。
- 6、“十一、基金的业绩”更新了截至2017年9月30日的基金业绩数据。
- 7、“二十三、对基金份额持有人的服务”更新了定期定额投资计划的相关内容。
- 8、“二十四、其他应披露事项”对本报告期内的相关公告作了信息披露。

上述内容仅为摘要，须与本基金《招募说明书》后面所载之详细资料一并阅读。

华宝基金管理有限公司

2017年12月27日