

华宝可转债债券型证券投资基金 招募说明书（更新）摘要

2020 年第 1 次重大信息临时更新

基金管理人：华宝基金管理有限公司

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》、《基金合同》及基金产品资料概要，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者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。

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。

本次更新招募说明书仅对本基金增加C类基金份额相关事项进行了相应更新，相关内容截止日为2020年1月3日；根据2019年9月1日生效的《信息披露办法》及《基金合同》、《托管协议》的修订，更新《招募说明书》“重要提示”、“绪言”、“释义”、“基金管理

人”、“相关服务机构”、“基金份额的申购与赎回”、“基金收益与分配”、“基金的会计与审计”、“基金的信息披露”、法律文件摘要等章节内容，相关内容截止日为 2019 年 12 月 26 日；其他所载内容截止日为 2019 年 4 月 27 日；有关财务数据和净值表现数据截止日为 2019 年 3 月 31 日，财务数据未经审计。

本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。

一、《基金合同》生效日期

本基金基金合同生效日：2011 年 4 月 27 日

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 03 月 07 日

注册资本：1.5 亿元人民币

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、董事会信息

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，中国宝武钢铁集团有限公司产业金融党工委副书记、纪工委书记、工会工委主席，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。

魏臻先生，董事。曾任麦肯锡（上海）咨询公司分析师，摩根斯坦利亚洲公司分析师，香港人人媒体总监。现任华平投资集团董事总经理、神州租车控股公司董事、九月教育集团董事、中通快递董事。

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执行董事兼总经理。

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、监事会信息

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、华宝投资有限公司工作，现任华宝信托有限责任公司风险管理部副总经理。

贺桂先先生，监事，本科。曾任华宝信托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兼北京分公司总经理兼综合管理部总经理。

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互金业务总监兼互金策划部总经理。

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（黄小薏）女士，总经理，简历同上。

向辉先生，副总经理，硕士。曾在武汉长江金融审计事务所任副所长、在长盛基金管理有限公司市场部任职。2002 年加入华宝基金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、董事会秘书，宝钢金融系统党委组织部部长、党委办公室主任。现任华宝基金管理有限公司副总经理。

李慧勇先生，副总经理，硕士。曾在上海申银万国证券研究所有限公司担任董事总经理/所长助理/研究执行委员会副主任/首席分析师的职务。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

李栋梁，硕士，拥有 CFA 资格。曾在国联证券有限责任公司、华宝信托有限责任公司和太平资产管理有限公司从事固定收益的研究和投资。2010 年 9 月加入华宝基金管理有限公司，担任债券分析师、基金经理助理等职务，现任固定收益部副总经理。2011 年 6 月起担任华宝宝康债券投资基金基金经理，2014 年 10 月起任华宝增强收益债券型证券投资基金基金经理，2015 年 10 月至 2017 年 12 月任华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）和华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 4 月起任华宝宝鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2016 年 6 月起任华宝可转债债券型证券投资基金基金经理，2016 年 9 月至 2017 年 12 月任华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 12 月起任华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 1 月至 2018 年 6 月任华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 2 月起任华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 7 月任华宝新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 8 月任华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 6 月至 2019 年 3 月任华宝新优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

5、 固收投决会信息

李慧勇先生，公司副总经理。

李栋梁先生，固定收益部副总经理、华宝宝康债券投资基金、华宝增强收益债券型证券投资基金、华宝宝鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金、华宝可转债债券型证券投资基金、华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金、华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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

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、依法募集资金，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、编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、按照规定召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人承诺

1、基金管理人将遵守《基金法》、《中华人民共和国证券法》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）利用基金财产或者职务之便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）侵占、挪用基金财产；
- （6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （7）玩忽职守，不按照规定履行职责；
- （8）法律、行政法规和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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （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，基金管理人建立了一套完整的风险管理体系，具体包括以下内容：

- （1）搭建风险管理环境。具体包括制定风险管理战略、目标，设置相应的组织机构、建立清晰的责任线路和报告渠道、配备适当的人力资源、开发适用的技术支持系统等内容。
- （2）识别风险。辨识公司运作和基金管理中存在的风险。
- （3）分析风险。检查存在的控制措施，分析风险发生的可能性及其引起的后果并将风险

归类。

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

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

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

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

2、内部控制制度

（1）内部风险控制原则

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

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

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

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

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

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

本，保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果；

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

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

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

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

（2）内部风险控制的要求和内容

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

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

（3）督察长制度

公司设督察长，督察长由公司总经理提名，董事会聘任，并应当经全体独立董事同意。

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

（4）监察稽核及风险管理制度

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

监察稽核部和风险管理部负责调查评价公司内控制度的健全性、合理性；负责调查、评价公司有关部门执行公司各项规章制度的情况；评价各项内控制度执行的有效性，对内控制度的

缺失提出补充建议；进行日常风险监控工作；协助评价基金财产风险状况；负责包括基金经理离任审查在内的各项内部审计事务等。

3、基金管理人关于内部控制制度的声明书

- （1）基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- （2）基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人发展不断完善内部控制制度。

三、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。截至2019年3月31日，本集团总资产67,943.47亿元人民币，高级法下资本充足率15.86%，权重法下资本充足率13.28%。

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，现下设业务管理团队、产品管理团队、项目管理团队、稽核监察团队、基金外包业

务团队、养老金团队、系统与数据团队 7 个职能团队，现有员工 80 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）、合格境内机构投资者托管（QDII）、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，推出国内首个托管大数据平台，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。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016 年 6 月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获得该奖项的托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7 月荣膺 2016 年中国资产管理“金贝奖”“最佳资产托管银行”。2017 年 6 月招商银行再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”；“全功能网上托管银行 2.0”荣获《银行家》2017 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；8 月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”。2018 年 1 月招商银行荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2017 年度优秀资产托管机构”奖项；同月，招商银行托管大数据平台风险管理系统荣获 2016-2017 年度银监会系统“金点子”方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖；3 月荣膺公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖；5 月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”；12 月荣膺 2018 东方财富风云榜“2018 年度最佳托管银行”、“20 年最值得信赖托管银行”奖。2019 年 3 月招商银行荣获《中国基金报》“2018 年度最佳基金托管银行”奖。

（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。

王良先生，本行副行长，货币银行学硕士，高级经济师。1991 年至 1995 年，在中国科技国际信托投资公司工作；1995 年 6 月至 2001 年 10 月，历任招商银行北京分行展览路支行、东三环支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理；2001 年 10 月至 2006 年 3 月，历任北京分行行长助理、副行长；2006 年 3 月至 2008 年 6 月，任北京分行党委书记、副行长（主持工作）；2008 年 6 月至 2012 年 6 月，任北京分行行长、党委书记；2012 年 6 月至 2013 年 11 月，任招商银行总行行长助理兼北京分行行长、党委书记；2013 年 11 月至 2014 年 12 月，任招商银行总行行长助理；2015 年 1 月起担任本行副行长；2016 年 11 月起兼任本行董事会秘书。

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 2019 年 3 月 31 日，招商银行股份有限公司累计托管 450 只证券投资基金。

（四）托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

招商银行确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管制度，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；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：

一级风险防范是在招商银行总行风险管控层面对风险进行预防和控制；

二级风险防范是招商银行资产托管部设立稽核监察团队，负责部门内部风险预防和控制；

三级风险防范是招商银行资产托管部在设置专业岗位时，遵循内控制衡原则，视业务的风险程度制定相应监督制衡机制。

3、内部控制原则

（1）全面性原则。内部控制覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有团队和岗位。

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

（3）独立性原则。招商银行资产托管部各团队、各岗位职责保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间相互分离。内部控制的检查、评价部门独立于内部控制的建立和执行部门。

（4）有效性原则。内部控制具有高度的权威性，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能够得到及时的反馈和纠正。

（5）适应性原则。内部控制适应招商银行托管业务风险管理的需要，并能够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。

（6）防火墙原则。招商银行资产托管部配备独立的托管业务技术系统，包括网络系统、应用系统、安全防护系统、数据备份系统。

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

（8）制衡性原则。内部控制能够实现在托管组织体系、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。

4、内部控制措施

（1）完善的制度建设。招商银行资产托管部从资产托管业务内控管理、产品受理、会计核算、资金清算、岗位管理、档案管理和信息管理等方面制定一系列规章制度，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。

（2）经营风险控制。招商银行资产托管部制定托管项目审批、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在数据传输和保存方面有严格的加密和备份措施，采用加密、直连方式传输数据，数据执行异地实时备份，所有的业务信息须经过严格的授权方能进行访问。

（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、托管业务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，对信息技术系统采取两地三中心的应急备份管理措施等，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管理。

（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》等有关法律法规的规定及基金合同、托管协议的约定，对基金投资范围、投资比例、投资组合等情况的合法性、合规性进行监督和核查。

在为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，基金托管人对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与支付情况进行检查监督，对违反法律法规、基金合同的指令拒绝执行，并立即通知基金管理人。

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，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律法规及基金合同允许的调整期限。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。基金管理人对于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。

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

名称：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 号环球金融中心 58 楼

法定代表人：孔祥清

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

直销柜台传真：021-50499663、50988055

联系人：章希

网址：www.fsfund.com

（2）直销 e 网金

投资者可以通过华宝基金管理有限公司网上交易直销 e 网金系统办理本基金的认/申购、赎回、转换等业务，具体交易细则请参阅华宝基金管理有限公司网站公告。网上交易网址：
www.fsfund.com。

（二）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

邮编：100140

法定代表人：陈四清

联系电话：95588

客户服务电话：95588；010-66106114

公司网址：www.icbc.com.cn

（2）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

邮编：100818

法定代表人：刘连舸

联系人：陈洪源

联系电话：95566

客户服务电话：95566

公司网址：www.boc.cn

（3）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

邮编：100033

法定代表人：田国立

联系电话：95533

客户服务电话：95533

公司网址：www.ccb.com

（4）交通银行股份有限公司

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

邮编：200120

法定代表人：彭纯

联系人：曹榕

联系电话：95559

传真：（021）58408483

客户服务电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

（5）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

邮编：518040

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

联系电话：95555

客户服务电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

（6）兴业银行股份有限公司

办公地址：中国福州市湖东路154号

邮编：350003

法定代表人：高建平

联系电话：95561

客户服务电话：95561

公司网址：www.cib.com.cn

（7）中国民生银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区西绒线胡同 28 号天安国际办公楼

邮编：100031

法定代表人：洪崎

联系人：王志刚

联系电话：95568

传真：010-57092611

客户服务电话：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

（8）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

邮编：300012

法定代表人：李伏安

联系人：王星

联系电话：400-888-8811

客户服务电话：95541

公司网址：www.cbhb.com.cn

（9）江苏银行股份有限公司

办公地址：南京市中华路 26 号

邮编：210001

法定代表人：夏平

联系电话：400-869-6098

客户服务电话：96098，40086-96098

公司网址：www.jsbchina.cn

（10）平安银行股份有限公司

办公地址：广东省深圳市深南东路 5047 号

邮编：518001

法定代表人：谢永林

联系人：戴青

联系电话：95511

客户服务电话：95511-3

公司网址：www.bank.pingan.com

（11）上海浦东发展银行股份有限公司

办公地址：上海市中山东一路 12 号

邮编：200002

法定代表人：高国富

联系人：胡子豪

联系电话：95528

传真：021-61162165

客户服务电话：95528

公司网址：www.spdb.com.cn

（12）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

邮编：100010

法定代表人：李庆萍

联系人：王晓琳

联系电话：95558

客户服务电话：95558

公司网址：www.citicbank.com

（13）北京汇成基金销售有限公司

联系电话：400-619-9059

公司网址：<http://www.hcjijin.com/>

（14）北京百度百盈基金销售有限公司

办公地址：北京市海淀区上地信息路甲9号奎科大厦

联系电话：95055

公司网址：www.baiyingfund.com

（15）珠海盈米基金销售有限公司

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

客户服务电话：020-89629099

公司网址：www.yingmi.cn

（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

邮编：518026

法定代表人：王连志

联系人：陈剑虹

客户服务电话：95517

公司网址：www.essence.com.cn

（17）渤海证券股份有限公司

办公地址：天津市南开区滨水西道8号（奥体中心北侧）

法定代表人：王春峰

联系人：王星

传真：022-28451958

客户服务电话：400-651-5988

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

邮编：518034

法定代表人：丁益

联系人：梁浩

客户服务电话：400-6666-888

公司网址：www.cgws.com

（19）长江证券股份有限公司

办公地址：湖北省武汉市江汉区新华路特8号

邮编：430015

法定代表人：李新华

联系人：奚博宇

传真：027-85481900

客户服务电话：95579

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：宋春

客户服务电话：400-6262-818

公司网址：www.5irich.com

（21）上海大智慧基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11层

联系人：裘爱萍

客户服务电话：021-20219931

公司网址：<https://8.gw.com.cn/>

（22）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

传真：010-61840699

客户服务电话：4000618518

公司网址：<https://danjuanapp.com/>

（23）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：武晓春

联系人：刘熠

传真：862168767981

客户服务电话：400-8888-128

公司网址：www.tebon.com.cn

（24）东北证券股份有限公司

办公地址：长春市生态大街 6666 号

邮编：130118

法定代表人：李福春

联系人：安岩岩

传真：0431-85096795

客户服务电话：95360

公司网址：www.nesc.cn

（25）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

邮编：200010

法定代表人：潘鑫军

联系人：王欣

传真：021-63326729

客户服务电话：95503

公司网址：www.dfzq.com.cn

（26）东海证券股份有限公司

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：赵俊

联系人：王一彦

传真：021-50498825

客户服务电话：95531；400-8888-588

公司网址：www.longone.com.cn

（27）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

邮编：215021

法定代表人：范力

联系人：陆晓

联系电话：400-860-1555

传真：0512-62938527

客户服务电话：95330

公司网址：www.dwzq.com.cn

（28）光大证券股份有限公司

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号 3 楼

法定代表人：周健男

联系人：李晓哲

联系电话：95525

传真：021-22169134

客户服务电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

（29）广发证券股份有限公司

办公地址：广东省广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

法定代表人：孙树明

联系人：马梦洁

客户服务电话：95575

公司网址：www.gf.com.cn

（30）国都证券股份有限公司

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

邮编：100007

法定代表人：王少华

联系人：司琪

传真：010-84183311

客户服务电话：400-818-8118

公司网址：www.guodu.com

（31）国泰君安证券股份有限公司

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

联系人：朱雅崑

联系电话：400-888-6628

传真：021-38670666

客户服务电话：95521

公司网址：www.gtja.com

（32）国信证券股份有限公司

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：周杨

联系电话：95536

传真：0755-82133952

客户服务电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

（33）国元证券股份有限公司

法定代表人：凤良志

联系人：米硕

联系电话：95578

客户服务电话：4008888777 或 95578

公司网址：www.gyzq.com.cn

（34）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

联系电话：95553

客户服务电话：95553、400—8888—001 或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址：www.htsec.com

（35）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

客户服务电话：400-700-9665

公司网址：www.ehowbuy.com

（36）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

客户服务电话：400-920-0022

公司网址：www.licaik.com

（37）恒泰证券股份有限公司

办公地址：呼和浩特市新城区海拉尔东街满世书香苑办公楼 7 楼

邮编：010010

法定代表人：庞介民

联系人：熊丽

客户服务电话：400-196-6188

公司网址：www.cnht.com.cn

（38）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

邮编：830002

法定代表人：李琦

联系人：陈飙

传真：0991-2301927

客户服务电话：400-800-0562

公司网址：www.hysec.com

（39）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

邮编：230081

法定代表人：章宏韬

联系人：范超

联系电话：400-809-6518

传真：0551-65161672

客户服务电话：95318

公司网址：www.hazq.com

（40）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

邮编：200120

法定代表人：陈林

传真：021-68777822

客户服务电话：400-820-9898

公司网址：www.cnhbstock.com

（41）华福证券有限责任公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号招商银行上海大厦 18-19 层

法定代表人：黄金琳

联系人：王虹

联系电话：0591-96326

传真：021-20655196

客户服务电话：95547

公司网址：www.hfzq.com.cn

（42）华泰证券股份有限公司

办公地址：南京市江东中路 288 号

邮编：210019

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

传真：021-83387254

客户服务电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

（43）上海华夏财富投资管理有限公司

客户服务电话：400-817-5666

（44）上海基煜基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

客户服务电话：400-820-5369

公司网址：www.jiyufund.com.cn

（45）江海证券有限公司

办公地址：哈尔滨市松北区创新三路 833 号

邮编：150028

法定代表人：赵宏波

联系人：姜志伟

联系电话：400-666-2288

传真：0451-82337279

客户服务电话：400-666-2288

公司网址：www.jhzq.com.cn

（46）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

客户服务电话：400-166-1188

公司网址：http://8.jrj.com.cn

（47）北京肯特瑞基金销售有限公司

办公地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

客户服务电话：4000988511

公司网址：http://kenterui.jd.com

（48）上海联泰资产管理有限公司

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

客户服务电话：4000-466-788

公司网址：www.66zichan.com

（49）上海陆金所基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

客户服务电话：4008219031

公司网址：www.lufunds.com

（50）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

联系电话：4000-776-123

客户服务电话：4000-776-123

公司网址：http://www.fund123.cn/

（51）民生证券股份有限公司

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

邮编：100005

法定代表人：冯鹤年

联系人：韩秀萍

传真：010-85127917

客户服务电话：95376

公司网址：www.msza.com

（52）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

办公地址：上海杨浦区秦皇岛路 32 号 C 栋 2 楼

客户服务电话：400—821—5399

公司网址：www.noah-fund.com

（53）平安证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：何之江

联系人：周一涵

传真：0755-82435367

客户服务电话：95511-8

公司网址：www.stock.pingan.com

（54）山西证券股份有限公司

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：韩笑

联系电话：400-666-1618

传真：0351—8686619

客户服务电话：400-666-1618、95573

公司网址：www.i618.com.cn

（55）上海证券有限责任公司

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：李俊杰

联系人：邵珍珍

联系电话：400-891-8918

传真：021-53686100，021-53686200

客户服务电话：400-891-8918

公司网址：www.shzq.com

（56）申万宏源证券有限公司

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 40 楼

邮编：200031

法定代表人：李梅

联系人：陈飙

传真：021-33388224

客户服务电话：95523

公司网址：www.swhysc.com

（57）南京苏宁基金销售有限公司

客户服务电话：95177

公司网址：www.snjijin.com

（58）深圳腾元基金销售有限公司

办公地址：深圳市福田区金田路 2028 号卓越世纪中心 1 号楼 1806-1810

法定代表人：曾革

联系人：杨苗苗

联系电话：400-877-899

客户服务电话：4006-877-899

公司网址：www.tenyuanfund.com

（59）上海天天基金销售有限公司

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

客户服务电话：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

（60）浙江同花顺基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

联系人：张丽琼

客户服务电话：4008-773-772

公司网址：www.5ifund.com

（61）上海挖财基金销售有限公司

客户服务电话：021-50810673

公司网址：www.wacaijijin.com

（62）西南证券股份有限公司

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

邮编：400023

法定代表人：廖庆轩

联系人：周青

传真：023-63786212

客户服务电话：4008-096-096

公司网址：www.swsc.com.cn

（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

客户服务电话：010-62675369

公司网址：www.xincai.com

（64）信达证券股份有限公司

办公地址：北京市西城区宣武门西大街甲 127 号大成大厦 6 层

法定代表人：张志刚

联系人：张晓辰

联系电话：400-800-8899

传真：010-63081344

客户服务电话：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

法定代表人：杨华辉

联系人：（公邮）

联系电话：95562

客户服务电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

（66）宜信普泽（北京）基金销售有限公司

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

联系电话：400-6099-200

客户服务电话：400-6099-200

公司网址：www.yixinfund.com

（67）奕丰金融服务（深圳）有限公司

客户服务电话：400-684-0500

公司网址：www.ifastps.com.cn

（68）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

邮编：100033

法定代表人：陈共炎

联系人：辛国政

传真：010-83574807

客户服务电话：4008-888-888 或 95551

公司网址：www.chinastock.com.cn

（69）招商证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦 23 楼

邮编：518033

法定代表人：霍达

联系人：黄婵君

联系电话：95565

传真：0755-82943227

客户服务电话：95565

公司网址：www.newone.com.cn

（70）中航证券有限公司

办公地址：北京市朝阳区望京东园四区2号 中航资本大厦35层

邮编：100102

法定代表人：王晓峰

联系人：王紫雯

联系电话：400-886-6567

传真：010-59562637

客户服务电话：400-8866-567

公司网址：www.avicsec.com

（71）中国国际金融股份有限公司

办公地址：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：毕明建

联系人：吕卓

联系电话：010-65051166

传真：010-65058065

客户服务电话：400-910-1166

公司网址：www.cicc.com

（72）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

客户服务电话：400-600-0030

公司网址：www.bzfund.com

（73）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：秦雨晴

联系电话：95538

传真：021-20315125

客户服务电话：95538

公司网址：www.zts.com.cn

（74）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：胡芷境

传真：0755-82026539

客户服务电话：95532 或 400-600-8008

公司网址：www.china-invs.cn

（75）中信建投证券股份有限公司

办公地址：北京东城区朝内大街 2 号凯恒中心 B 座 18 层

法定代表人：王常青

联系人：许梦园

客户服务电话：95587

公司网址：www.csc108.com

（76）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

法定代表人：张皓

联系人：刘宏莹

联系电话：010-60838677

传真：0755-83217421

客户服务电话：400-990-8826

公司网址：www.citicsf.com

（77）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

邮编：100026

法定代表人：张佑君

联系人：王一通

传真：010-60833739

客户服务电话：95548

公司网址：www.cs.ecitic.com

（78）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

邮编：266000

法定代表人：姜晓林

联系人：刘晓明

传真：0532-85022605

客户服务电话：95548

公司网址：<http://sd.citics.com/>

（79）中银国际证券股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 31 楼

邮编：200120

法定代表人：宁敏

联系人：许慧琳

联系电话：400-620-8888

传真：021-50372474

客户服务电话：400-620-8888

公司网址：www.bocichina.com

（80）深圳众禄基金销售股份有限公司

办公地址：深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼

联系电话：400-678-8887

客户服务电话：400-678-8887

公司网址：www.zlfund.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并在基金管理人网站公告。

（二） 注册登记机构：华宝基金管理有限公司

注册地址：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

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

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

五、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（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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

标普中国可转债指数收益率×70% + 上证国债指数收益率×30%。

标普中国可转债指数由标普道琼斯指数公司推出，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（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

（10）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（11）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

（12）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）基金投资组合报告

本基金投资组合报告所载数据截至 2019 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 | 64,602,196.02 | 86.07 |
| | 其中：债券 | 64,602,196.02 | 86.07 |
| | 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 | 7,400,478.13 | 9.86 |
| 8 | 其他资产 | 3,058,357.02 | 4.07 |
| 9 | 合计 | 75,061,031.17 | 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

本基金本报告期末未持有股票。

（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

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 | 债券种类 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 2,802,150.00 | 4.70 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 502,500.00 | 0.84 |
| | 其中：政策性金融债 | 502,500.00 | 0.84 |
| 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） | 61,297,546.02 | 102.78 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 64,602,196.02 | 108.32 |

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 | 113011 | 光大转债 | 40,000 | 4,594,800.00 | 7.70 |
| 2 | 123021 | 万信转2 | 28,000 | 3,317,440.00 | 5.56 |
| 3 | 132015 | 18中油EB | 25,000 | 2,511,750.00 | 4.21 |
| 4 | 019544 | 16国债16 | 25,000 | 2,501,250.00 | 4.19 |
| 5 | 132011 | 17浙报EB | 23,280 | 2,188,320.00 | 3.67 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1） 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

（2） 本基金投资股指期货的投资政策

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） 本基金本报告期末未持有股票投资。

（3） 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 8,762.46 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,752,109.59 |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 149,114.98 |
| 5 | 应收申购款 | 148,369.99 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 3,058,357.02 |

（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 | 113011 | 光大转债 | 4,594,800.00 | 7.70 |
| 2 | 132015 | 18 中油 EB | 2,511,750.00 | 4.21 |
| 3 | 132011 | 17 浙报 EB | 2,188,320.00 | 3.67 |
| 4 | 123015 | 蓝盾转债 | 2,022,933.85 | 3.39 |

| | | | | |
|----|--------|----------|--------------|------|
| 5 | 127006 | 敖东转债 | 1,835,830.00 | 3.08 |
| 6 | 127007 | 湖广转债 | 1,803,750.00 | 3.02 |
| 7 | 128039 | 三力转债 | 1,798,889.39 | 3.02 |
| 8 | 127005 | 长证转债 | 1,724,850.00 | 2.89 |
| 9 | 110043 | 无锡转债 | 1,647,000.00 | 2.76 |
| 10 | 123003 | 蓝思转债 | 1,608,300.00 | 2.70 |
| 11 | 123007 | 道氏转债 | 1,589,508.70 | 2.67 |
| 12 | 123012 | 万顺转债 | 1,539,950.70 | 2.58 |
| 13 | 128038 | 利欧转债 | 1,490,280.00 | 2.50 |
| 14 | 132007 | 16 凤凰 EB | 1,479,750.00 | 2.48 |
| 15 | 132004 | 15 国盛 EB | 1,469,100.00 | 2.46 |
| 16 | 128020 | 水晶转债 | 1,343,400.00 | 2.25 |
| 17 | 128045 | 机电转债 | 1,291,620.00 | 2.17 |
| 18 | 113014 | 林洋转债 | 1,268,760.00 | 2.13 |
| 19 | 110042 | 航电转债 | 1,230,500.00 | 2.06 |
| 20 | 128034 | 江银转债 | 1,162,200.00 | 1.95 |
| 21 | 110031 | 航信转债 | 1,120,300.00 | 1.88 |
| 22 | 128035 | 大族转债 | 1,099,500.00 | 1.84 |
| 23 | 113518 | 顾家转债 | 1,077,219.10 | 1.81 |
| 24 | 110041 | 蒙电转债 | 993,664.00 | 1.67 |
| 25 | 113508 | 新风转债 | 963,935.20 | 1.62 |
| 26 | 110045 | 海澜转债 | 835,822.00 | 1.40 |
| 27 | 128014 | 永东转债 | 831,331.50 | 1.39 |
| 28 | 123009 | 星源转债 | 803,318.10 | 1.35 |
| 29 | 128017 | 金禾转债 | 714,046.24 | 1.20 |
| 30 | 113509 | 新泉转债 | 624,335.70 | 1.05 |
| 31 | 113009 | 广汽转债 | 593,198.80 | 0.99 |
| 32 | 113511 | 千禾转债 | 555,050.00 | 0.93 |
| 33 | 110034 | 九州转债 | 552,100.00 | 0.93 |
| 34 | 113513 | 安井转债 | 508,212.10 | 0.85 |
| 35 | 113008 | 电气转债 | 364,860.00 | 0.61 |
| 36 | 113013 | 国君转债 | 258,133.80 | 0.43 |
| 37 | 113017 | 吉视转债 | 157,776.20 | 0.26 |
| 38 | 132009 | 17 中油 EB | 101,900.00 | 0.17 |
| 39 | 113512 | 景旺转债 | 50,376.30 | 0.08 |

（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。

（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

六、基金的业绩

基金业绩截止日为 2019 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% |
| 2016/01/01-2016/12/31 | -16.82% | 0.61% | -6.39% | 0.49% | -10.43% | 0.12% |
| 2017/01/01-2017/12/31 | -6.59% | 0.37% | -0.56% | 0.33% | -6.03% | 0.04% |
| 2018/01/01-2018/12/31 | -7.26% | 0.55% | 0.88% | 0.44% | -8.14% | 0.11% |
| 2019/01/01-2019/03/31 | 19.30% | 0.97% | 12.27% | 0.67% | 7.03% | 0.30% |
| 2011/04/27-2019/03/31 | 0.92% | 1.29% | 20.63% | 0.90% | -19.71% | 0.39% |

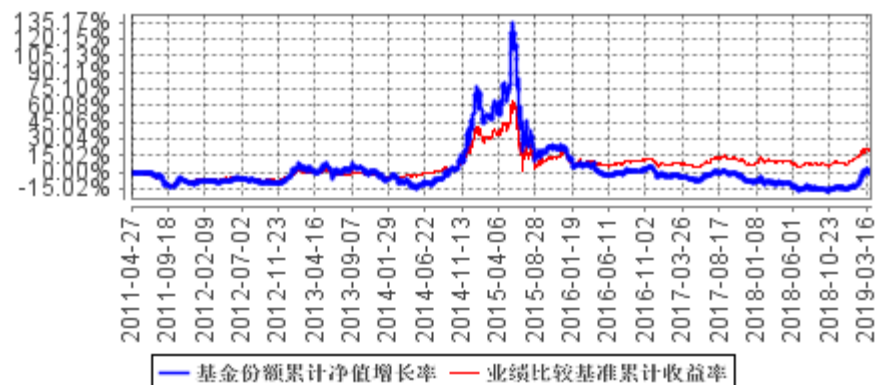
2、自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较：

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 2019 年 3 月 31 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。

七、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，并在基金管理人网站公示。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介上公告。

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介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介上公告。

（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 1 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 1 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 1 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 1 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介上刊登公告。

3、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。

4、基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制、单个投资者单日或单笔申购金额上限、本基金总规模限额和单日净申购比例上限。基金管理人必须在调整前依照《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。

（六）申购费与赎回费

1. 申购费

本基金 A 类基金份额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 A 类基金份额，申购费率按每笔申购申请单独计算。本基金的 A 类基金份额申购费率表如下：

| 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% |

A 类基金份额的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。

本基金的 C 类基金份额不收取申购费。

2. 赎回费

本基金的赎回费随基金持有时间的增加而递减。

本基金的 A 类基金份额赎回费率表如下：

| 持有时间 | 赎回费率 |
|-------------------|------|
| 7 天以内 | 1.5% |
| 7 天以上（含 7 天）-两年以内 | 0.5% |
| 两年以上（含两年） | 0% |

A 类基金份额赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对于收取的持续持有期少于 7 日的投资者的赎回费，基金管理人将其全额计入基金财产。对于收取的持续持有期大于等于 7 日的投资者的赎回费，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。

本基金的 C 类基金份额赎回费率表如下：

| 持有时间 | 赎回费率 |
|--------------|------|
| 7 天以内 | 1.5% |
| 7 天以上（含 7 天） | 0% |

对 C 类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。

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介上公告。

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

（1）A 类基金份额

申购费用适用比例费率的情形下：

净申购金额 = 申购金额 / [1 + 申购费率]

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日 A 类基金份额净值

申购费用适用固定金额的情形下：

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/T 日 A 类基金份额净值

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 A 类基金份额，其对应的申购费率为 0.8%，T 日本基金 A 类基金份额净值为 1.0695 元人民币，则其可得到的 A 类基金份额计算如下：

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 A 类基金份额，可得到 37,103.82 份 A 类基金份额。

（2）C 类基金份额

本基金 C 类基金份额不收取申购费用：

净申购金额=申购金额

申购份额=净申购金额/T 日 C 类基金份额净值

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：投资者投资 10 万元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日的 C 类基金份额净值为 1.0861 元，该投资者可得到的 C 类基金份额为：

净申购金额=100,000.00 元

申购份额=100,000.00/1.0861=92,072.55 份

即：投资者投资 10 万元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日的 C 类基金份额净值为 1.0861 元，可得到 92,072.55 份 C 类基金份额。

2. 赎回金额的计算方式

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用，A 类基金份额与 C 类基金份额赎回金额的计算方法相同，仅适用的赎回费率不同。其中：

赎回总额=赎回份额×赎回当日该类基金份额净值

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 A 类基金份额，T 日 A 类基金份额净值为 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 A 类基金份额，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。但当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。
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. 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额数的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。
7. 申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。
8. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、8 项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介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。当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项；

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，并在指定媒介上公告。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）当发生巨额赎回时，若存在单个赎回申请人当日申请赎回的份额超过前一工作日基金总份额 20%（“大额赎回申请人”）的情形，基金管理人可以按照保护其他赎回申请人（“普通赎回申请人”）利益的原则，优先确认普通赎回申请人的赎回申请，在当日可接受赎回的范围内对普通赎回申请人的赎回申请予以全部确认或按单个账户赎回申请量占普通赎回申请人赎回申请总量的比例确认；在普通赎回申请人的赎回申请全部确认且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，在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例确认。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。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

（4）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，并应当在指定媒介上进行公告。

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，并在 2 日在指定媒介上刊登公告。

（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，基金管理人应在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

2. 如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介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 日在指定媒介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 日在指定媒介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。

八、《招募说明书》更新部分说明

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》）、《公开募集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《华宝可转债债券型证券投资基金招募说明书》作如下更新：

增加了 A 类基金份额、C 类基金份额及销售服务费等相关表述。

华宝基金管理有限公司

2020 年 1 月 3 日