华宝增强收益债券型证券投资基金招募说明书摘要（更新）

2018年第2号

基金管理人:华宝基金管理有限公司
基金托管人:中国工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《关于核准华宝兴业增强收益债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可［2008］1294号)的核准,进行募集。基金合同于2009年2月17日正式生效。

基金管理人保证《华宝增强收益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注册,但中国证监会对本基金募集的注册,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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率高于货币市场基金,但低于混合型基金和股票型基金。在债券型基金产品中,其长期平均风险程度和预期收益率高于纯债券基金。

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。同时,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者的风险承受能力相适应,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

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。

基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险,由投资者自行负担。

本招募说明书所载内容截止日为2018年8月17日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年6月30日,数据未经审计。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。

原招募说明书与本次更新的招募说明书不一致的,以本次更新的招募说明书为准。

一、《基金合同》生效日期

本基金自2009年1月5日到2009年2月13日向个人投资者和机构投资者同时发售,《基金合同》于2009年2月17日生效。

二、基金管理人

（一）基金管理人概况

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）基金管理人主要人员情况

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)投资银行部分析师;现任美国华平集团中国金融行业负责人、董事总经理,华融资产管理股份有限公司董事,上海灿谷投资管理咨询服务有限公司董事。

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

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

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

2、监事会成员

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

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

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

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

李栋梁先生,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,2010年12月至2011年6月任华宝宝康债券投资基金基金经理助理,2011年6月起担任华宝宝康债券投资基金基金经理,2014年10月起兼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月兼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月兼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5月任固定收益部副总经理。2016年6月兼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月兼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月起兼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月兼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灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2017年3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月任华宝新优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

詹杰先生,硕士。曾在三星综合技术研究院、阿里巴巴云计算有限公司从事技术研究工作,在华创证券有限责任公司研究所、易方达基金管理有限公司从事行业研究工作。2015年9月加入华宝基金管理有限公司,先后担任投资经理助理、投资经理的职务。2018年8月担任华宝增强收益债券型证券投资基金和华宝大盘精选混合型证券投资基金基金经理。

本基金的历任基金经理如下:
牟旭东先生,其任职期间为2009年2月至2011年2月;
曾丽琼女士,其任职期间为2009年2月至2010年6月。
华志贵先生、其任职期间为2010年6月至2013年4月。
王瑞海先生,任职期间为2013年4月至2014年10月。

5、固定收益投资决策委员会成员

李慧勇先生,公司副总经理。

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。

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基金经理、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、华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、华宝新优享灵活配置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运作中存在的风险。

(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,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。

三、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间:1984年1月1日
法定代表人:易会满
注册资本:人民币35,640,625.71万元
联系电话:010-66105799
联系人:郭明

（二）主要人员情况

截至2018年6月,中国工商银行资产托管部共有员工212人,平均年龄33岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承"诚实信用、勤勉尽责"的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2018年6月,中国工商银行共托管证券投资基金874只。自2003 年以来,本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的61项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来,各项业务飞速发展,始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得,是与资产托管部"一手抓业务拓展,一手抓内控建设"的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作,在积极拓展各项托管业务的同时,把加强风险防范和控制的力度,精心培育内控文化,完善风险控制机制,强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014年八次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的SAS70(审计标准第70号)审阅后,2015年、2016年中国工商银行资产托管部均通过ISAE3402(原SAS70)审阅,迄今已第十次获得无保留意见的控制及有效性报告,表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可,也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨,达到国际先进水平。目前,ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营理念风格,形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系;防范和化解经营风险,保证托管资产的安全完整;维护持有人的权益;保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门(内控合规部、内部审计局)、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策,对各业务部门风险管理工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律规章,对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

(1)合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求,并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2)完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约;监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节,覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3)及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录;按照"内控优先"的原则,新设机构或新增业务品种时,必须做到已建立相关的规章制度。

(4)审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险,审慎经营,保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5)有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善,并保证得到全面落实执行,不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6)独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门;直接操作人员和控制人员必须相对独立,适当分离;内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

(1)严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离,建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度,并采取了良好的防火墙隔离制度,能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2)高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者,要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况,以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展,并根据检查情况提出内部控制措施,督促职能管理部门改进。

(3)人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制,建立"自控防线"、"互控防线"、"监控防线"三道控制防线,健全绩效考核和激励机制,树立"以人为本"的内控文化,增强员工的责任心和荣誉感,培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书,使员工树立风险防范与控制理念。

(4)经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务,从而有效地控制和配置组织资源,达到资源利用和效益最大化目的。

(5)内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理,定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控,指导业务部门进行风险识别、评估,制定并实施风险控制措施,排查风险隐患。

(6)数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7)应急准备与响应。资产托管部建立专门的灾难恢复中心,制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案,并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战,资产托管部不断提高演练标准,从最初的按照预订时间演练发展到现在的"随机演练"。从演练结果看,资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制

(1)资产托管部内部设置专职稽核监察部门,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律规章,全面贯彻落实全程监控思想,确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2)完善组织结构,实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与,只有这样,风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理,将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位,每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责,通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构,形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3)建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设,一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力,资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度,包括:岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等,覆盖所有部门和岗位,渗透各项业务过程,形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4)内部风险控制始终是托管部工作重点之一,保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务,资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作,一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展,新问题、新情况不断出现,资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置,视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

（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《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定,基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、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,其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、托管协议或有关基金法律法规规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对,并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内,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有重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

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。
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
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认/申购、赎回、转换等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上交易网址:www.fsfund.com。

2、代销机构

(1)中国工商银行股份有限公司
办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
邮编:100140
法定代表人:易会满
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
注册地址:北京市东城区建国门内大街69号
邮编:100005
法定代表人:周慕冰
联系电话:95599
客户服务电话:95599
公司网址:www.abchina.com

(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
注册地址:北京市复兴门内大街1号
邮编:100818
法定代表人:陈四清
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

(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
注册地址:北京市西城区金融大街25号
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

(5)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
注册地址: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

(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
注册地址: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

(7)兴业银行股份有限公司
办公地址:中国福州市湖东路154号
注册地址: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

(8)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
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
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

(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
注册地址:中国天津市河东区海河东路218号
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

(10)广发银行股份有限公司
办公地址:广东省广州市东风东路713号
注册地址:广东省广州市越秀区东风东路713号
邮编:510080
法定代表人:杨明生
联系电话:400-830-8003
客户服务电话:400-830-8003
公司网址:www.cgbchina.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号华夏银行大厦
注册地址:北京市东城区建国门内大街22号
邮编:100005
法定代表人:李民吉
联系电话:95577
客户服务电话:95577
公司网址:www.hxb.com.cn

(12)江苏银行股份有限公司
办公地址:南京市中华路26号
注册地址: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

(13)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
注册地址:广东省深圳市罗湖区深南东路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

(14)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
注册地址: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

(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
注册地址: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

(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
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
邮编:518026
法定代表人:王连志
联系人:陈剑虹
联系电话:4008-001-001
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:天津市南开区宾水西道8号(奥体中心北侧)
注册地址:天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
法定代表人:王春峰
联系人:王星
联系电话:400-651-5988
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
注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16-17楼
邮编:518034
法定代表人:丁益
联系人:金夏
联系电话:400-666-6888
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
注册地址:湖北省武汉市江汉区新华路特8号
邮编:430015
法定代表人:尤习贵
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)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
注册地址:上海市普陀区曹阳路510号南半幢9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

(21)东北证券股份有限公司
办公地址:长春市生态大街6666号
注册地址: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

(22)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
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-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

(23)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
注册地址:江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
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

(24)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
注册地址:江苏省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

(25)东兴证券股份有限公司
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人:魏庆华
联系人:夏锐
联系电话:400-888-8993
传真:010-66555246
客户服务电话:400-8888-993、95309
公司网址:www.dxzq.net.cn

(26)方正证券股份有限公司
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
注册地址: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:高利
联系人:程博怡
联系电话:95571
客户服务电话:95571
公司网址:www.foundersc.com

(27)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
注册地址:上海市静安区新闸路1508 号
法定代表人:周健男
联系人:李晓皙
联系电话:95525
传真:021-22169134
客户服务电话:95525
公司网址:www.ebscn.com

(28)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
注册地址:广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
法定代表人:孙树明
联系人:马梦洁
联系电话:95575
客户服务电话:95575
公司网址:www.gf.com.cn

(29)国都证券股份有限公司
办公地址:北京市东城区东直门内大街3号国华投资大厦9层
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
邮编:100007
法定代表人:王少华
联系人:李弢
联系电话:400-818-8118
传真:010-84183311
客户服务电话:400-818-8118
公司网址:www.guodu.com

(30)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
注册地址: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
传真:021-38670666
客户服务电话:95521
公司网址:www.gtja.com

(31)海通证券股份有限公司
办公地址:上海市广东路689号
注册地址:上海市淮海中路98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

(32)恒泰证券股份有限公司
办公地址:呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座-14F
注册地址:呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座-14F
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

(33)申万宏源西部证券有限公司
办公地址:新疆乌鲁木齐市天山区文艺路233号宏源大厦8楼
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
邮编:830002
法定代表人:韩志谦
联系人:王怀春
传真:0991-2301927
客户服务电话:400-800-0562
公司网址:www.hysec.com

(34)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
注册地址: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

(35)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
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
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

(36)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
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8 层
法定代表人:黄金琳
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

(37)华泰证券股份有限公司
办公地址:南京市江东中路288号华泰证券一号楼
注册地址:南京市江东中路228号
邮编:210019
法定代表人:周易
联系人:马艺卿
联系电话:95597
传真:021-83387254
客户服务电话:95597
公司网址:www.htsc.com.cn

(38)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
注册地址:哈尔滨市香坊区赣水路56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

(39)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
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16-18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.mszq.com

(40)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
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼
法定代表人:姜志军
联系人:程博怡
客户服务电话:400-889-5618
公司网址:www.e5618.com

(41)平安证券股份有限公司
办公地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
注册地址: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:何之江
联系人:周驰
传真:0755-82435367
客户服务电话:95511-8
公司网址:www.stock.pingan.com

(42)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
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
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

(43)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
注册地址: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:021-962518
公司网址:www.962518.com

(44)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
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
邮编:200031
法定代表人:李梅
联系人:陈飙
传真:021-33388224
客户服务电话:95523
公司网址:www.swhysc.com

(45)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
注册地址: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: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

(46)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
注册地址:福州市湖东路268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

(47)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
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座2-6层
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

(48)招商证券股份有限公司
办公地址:深圳福田区益田路江苏大厦A座30楼
注册地址:深圳福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:霍达
联系人:黄婵君
传真:0755-82943227
客户服务电话:95565
公司网址:www.newone.com.cn

(49)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
注册地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41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

(50)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
注册地址: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
传真:010-65058065
客户服务电话:400-910-1166
公司网址:www.cicc.com

(51)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
注册地址:山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人:李玮
联系人: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

(52)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
注册地址: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

(53)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
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
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

(54)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
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
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

(55)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
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
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

(56)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
注册地址:青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
邮编:266000
法定代表人:姜晓林
联系人:刘晓明
联系电话:95548
传真:0532-85022605
客户服务电话:95548
公司网址:www.zxwt.com.cn

(57)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
注册地址:上海浦东银城中路200号中银大厦39层
邮编:200120
法定代表人:宁敏
联系人:许慧琳
传真:021-50372474
客户服务电话:4006208888
公司网址:www.bocichina.com

(58)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
注册地址: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/

(59)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

(60)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.licaike.com

(61)上海华夏财富投资管理有限公司
客户服务电话:400-817-5666

(62)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
注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153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

(63)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

(64)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
客户服务电话:4000988511
公司网址:http://kenterui.jd.com

(65)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

(66)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
客户服务电话:4008219031
公司网址:www.lufunds.com

(67)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

(68)南京苏宁基金销售有限公司
注册地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
客户服务电话:95177
公司网址:www.snjijin.com

(69)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

(70)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

(71)上海挖财金融信息服务有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
客户服务电话:021-50810673
公司网址: www.wacaijijin.com

(72)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
客户服务电话:400-821-0203

(73)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

(74)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
客户服务电话:400-6099-200
公司网址:www.yixinfund.com

(75)奕丰金融服务(深圳)有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
客户服务电话:400-684-0500
公司网址:www.ifastps.com.cn

(76)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.bzfunds.com

(77)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
注册地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801
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机构代理销售基金,并及时公告。

(二)注册登记机构:华宝基金管理有限公司(同上)

(三)律师事务所和经办律师
名称:通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:韩炯
联系电话:(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、基金简介

基金名称:华宝增强收益债券型证券投资基金
基金类型:契约型开放式基金

六、基金的投资

(一)本基金投资目标、范围、策略、业绩比较基准和风险收益特征

1、投资目标

在控制风险和保持资产流动性的前提下,追求较高的当期收益和总回报,争取实现基金资产的长期稳健增值。

2、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,包括公司债券、企业债券、可转换债券、短期融资券、金融债、资产支持证券、国债、央行票据、债券回购、股票、权证,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。

本基金投资于债券等固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%;投资于股票等权益类资产的比例不超过基金资产的20%;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%。

本基金可通过投资首次发行股票、增发新股、可转换债券转股票以及权证行权等方式获得股票,也可直接从二级市场买入股票。本基金可通过参与可分离转债申购而获得权证,也可直接从二级市场买入权证。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

3、投资策略

(1)资产配置策略

本基金采取积极的资产配置策略,通过宏观策略研究,对相关资产类别(包括固定收益类资产、权益类资产和货币市场资产等)的预期收益进行动态跟踪,决定其配置比例。

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债券类资产进行选择配置,同时也在银行间市场、交易所债券市场进行选择配置。

分类资产配置主要通过分析债券市场变化、投资人行为、品种间相对价值变化、债券供求关系变化和信用分析进行分类品种配置。可选择配置的品种范围有国债、金融债、企业债、央票、短期融资券等等。

(2)债券投资策略(不含可转换债券)

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)利率预期策略

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。如果预期未来利率将上升,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,如果预期未来利率下降,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)估值策略

通过比较债券的内在价值和市场价格而做出投资决策。当内在价值高于市场价格时,买入债券;当内在价值低于市场价格时,卖出债券。

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)互换策略

为加强对投资组合的管理,在卖出组合中部分债券的同时买入相似债券。该策略可以用来达到提高当期收益率或到期收益率、提高组合质量、减少税收等目的。

5)信用分析策略

根据宏观经济运行周期阶段,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。

(3)可转换债券投资策略

可转换债券同时具有债券、股票和期权的相关特性,结合了股票的长期增长潜力和债券的相对安全、收益固定的优势,并有利于从资产整体配置上分散和控制风险并提高收益水平。本基金将重点从公司基本面、债券价值(如票面利息、利息补偿及无条件回售价格)、保护条款的适用范围、期权价值的大小、基础股票的质地和成长性、基础股票的流通性等方面进行研究,在公司自行开发的可转债定价分析系统的支持下,充分发掘投资价值,并积极寻找各种套利机会,以获取更高的投资收益。

(4)资产支持证券投资策略

深入分析支持资产的构成及质量、发行条款等,进行积极投资。

(5)新股申购投资策略

鉴于新股投资是目前国内低风险、高收益的投资品种之一,本基金将积极参与新股申购,增强收益。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新股中签率,综合评估新股的投资价值,把握获利机会。

(6) 个股精选策略

采取定量与定性相结合的个股精选策略,使用成长、价值、盈利等方面的指标对股票进行排序,并对排名靠前的股票进行案头研究和实地调研,深入研究企业的基本面和长期发展前景,挑选出预期表现将超过大盘的个股,构建核心组合。

(7)权证投资策略

对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。

4、业绩比较基准

本基金业绩比较基准是中国债券总指数收益率×100%。

中国债券总指数由中央国债登记结算中心于2003年1月1日编制发布,样本涵盖交易所、银行间市场记帐式国债(固定、浮动利率)、金融债。中央国债登记结算有限公司将中国债券总指数情况于中国债券信息网(www.chinabond.com.cn)上公开发布。

从投资范围看,本基金主要投资于固定收益类金融工具,而中国债券总指数是目前涵盖范围最广的公开指数,涵盖了中国债券市场整体价格和投资回报情况;且指数样本是采集市场上真正在交易品种所制定出来的,有利于基金管理人以此指数为基准进行投资组合的配置。因此,本基金选择中国债券总指数作为业绩比较基准。

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股票指数时,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

5、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。在债券型基金产品中,其长期平均风险程度和预期收益率高于纯债券基金。

(二)投资程序

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),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建议。

行业研究人员根据数量化模型及对股票基本面的考察,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、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。

(三)投资限制与禁止行为

1、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%;

(4) 本基金在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的0.5%,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%。法律法规或中国证监会另有规定的,遵从其规定;

(5) 现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)和到期日不超过1年的政府债券不低于5%;

(6) 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%;

(7) 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%;

(9) 本基金财产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(10) 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定;

(11)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%;

(12)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;

(13)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;

(14) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

《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,基金不受上述限制。如法律法规或监管部门取消上述限制性规定,履行适当程序后,本基金不受上述规定的限制。

除上述第(5)、(12)、(13)项外,由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内,但基金管理人应在10个交易日内进行调整,以达到标准。其中因交易品种存在锁定期的原因,当股票等权益类资产合计超过基金净值的20%,基金管理人将在相关交易品种锁定期满后10个交易日内调整,以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

2、禁止行为

本基金禁止从事下列行为:

(1)承销证券;

(2)向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但是法律法规另有规定的除外;

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

(6)买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;

(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(8)依照法律、行政法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。

七、基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至2018年6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	10,724,801.81	6.45
	其中:股票	10,724,801.81	6.45
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	149,659,016.60	90.04
	其中:债券	149,659,016.60	90.04
	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	3,337,708.47	2.01
8	其他资产	2,496,452.11	1.50
9	合计	166,217,978.99	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	–	–
C	制造业	2,188,013.81	1.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	1,443,509.00	1.05
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	7,093,279.00	5.17
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	–	–
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	–	–
S	综合	–	–
	合计	10,724,801.81	7.82

(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	601998	中信银行	285,800	1,774,818.00	1.29
2	600030	中信证券	91,400	1,514,498.00	1.10
3	000651	格力电器	28,800	1,357,920.00	0.99
4	600029	南方航空	122,100	1,031,745.00	0.75
5	601328	交通银行	147,000	843,780.00	0.61
6	600525	长园集团	78,533	830,093.81	0.60
7	601818	光大银行	222,700	815,082.00	0.59
8	601988	中国银行	221,700	800,337.00	0.58
9	600999	招商证券	49,800	681,264.00	0.50
10	000776	广发证券	50,000	663,500.00	0.48

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	18,157,445.60	13.23
2	央行票据	–	–
3	金融债券	30,101,400.00	21.93
	其中:政策性金融债	20,292,400.00	14.79
4	企业债券	81,435,171.00	59.34
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	19,965,000.00	14.55
7	可转债(可交换债)	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	149,659,016.60	109.06

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	112025	11珠海债	110,000	11,102,300.00	8.09
2	140350	14进出50	100,000	10,269,000.00	7.48
3	101800351	18津城建MTN008A	100,000	10,003,000.00	7.29
4	010303	03国债(3)	100,660	9,981,445.60	7.27
5	101659008	16洪都航空MTN001	100,000	9,962,000.00	7.26

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)其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,422.69
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	2,388,445.88
5	应收申购款	93,583.54
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	2,496,452.11

(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)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

本基金业绩数据为截止2018年6月30日的数据,本报告中所列数据未经审计。

(一)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

1、华宝增强收益债券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
2009/02/17—2009/12/31	5.80%	0.19%	–2.54%	0.06%	8.34%	0.13%
2010/01/01—2010/12/31	0.51%	0.28%	–0.87%	0.10%	1.38%	0.18%
2011/01/01—2011/12/31	–4.71%	0.29%	2.52%	0.11%	–7.23%	0.18%
2012/01/01—2012/12/31	7.73%	0.18%	–0.67%	0.07%	8.40%	0.11%
2013/01/01—2013/12/31	2.27%	0.26%	–5.28%	0.11%	7.55%	0.15%
2014/01/01—2014/12/31	16.24%	0.26%	7.48%	0.15%	8.76%	0.11%
2015/01/01—2015/12/31	12.68%	0.17%	4.51%	0.12%	8.17%	0.05%
2016/01/01—2016/12/31	1.10%	0.08%	–1.80%	0.13%	2.90%	–0.05%
2017/01/01—2017/12/31	0.16%	0.10%	–4.26%	0.09%	4.42%	0.01%
2018/01/01—2018/06/30	0.03%	0.12%	2.99%	0.12%	–2.96%	0.00%
2009/02/17—2018/06/30	48.11%	0.21%	1.35%	0.11%	46.76%	0.10%

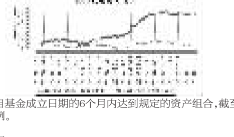
2、华宝增强收益债券B:

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
2009/02/17—2009/12/31	5.43%	0.19%	–2.54%	0.06%	7.97%	0.13%
2010/01/01—2010/12/31	0.11%	0.28%	–0.87%	0.10%	0.98%	0.18%
2011/01/01—2011/12/31	–5.09%	0.29%	2.52%	0.11%	–7.61%	0.18%
2012/01/01—2012/12/31	7.32%	0.18%	–0.67%	0.07%	7.99%	0.11%
2013/01/01—2013/12/31	1.85%	0.26%	–5.28%	0.11%	7.13%	0.15%
2014/01/01—2014/12/31	15.78%	0.26%	7.48%	0.15%	8.30%	0.11%
2015/01/01—2015/12/31	12.21%	0.17%	4.51%	0.12%	7.70%	0.05%
2016/01/01—2016/12/31	0.69%	0.08%	–1.80%	0.13%	2.49%	–0.05%
2017/01/01—2017/12/31	–0.14%	0.10%	–4.26%	0.09%	4.12%	0.01%
2018/01/01—2018/06/30	–0.18%	0.12%	2.99%	0.12%	–3.17%	0.00%
2009/02/17—2018/06/30	42.75%	0.21%	1.35%	0.11%	41.40%	0.10%

(二)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

华宝增强收益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
(2009年2月17日至2018年6月30日)

1、华宝增强收益债券A:



2、华宝增强收益债券B:

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2009年8月16日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

九、基金费用

(一) 与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

(1)基金管理人的管理费;

(2)基金托管人的托管费;

(3)销售服务费;

(4)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

(5)《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

(6)基金份额持有人大会费用;

(7)基金的证券交易费用;

(8)基金的银行汇划费用;

(9)按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

上述费用于基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1)基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H＝E×0.6%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前2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、公休假等,支付日期顺延。

(2)基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H＝E×0.2%÷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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

(3)基金的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售费,本基金B类基金份额的销售服务费年费率为0.4%,本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务,基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费按前一日B类份额的基金资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下:

H＝E×0.4%÷当年天数

H为基金每日应计提的销售服务费

E为前一日B类份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述一,基金费用的种类中第4－9项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

(1)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;

(2)基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

(3)《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;

(4)其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

4、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

(二) 与基金销售有关的费用

1、申购费和赎回费

(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,申购费率按每笔申购申请单独计算。本基金B类基金份额不收取申购费。

本基金A类基金份额的申购费率表如下:

申购金额	申购费率
50万以下	0.8%
大于等于50万,小于100万	0.6%
大于等于100万,小于200万	0.4%
大于等于200万,小于500万	0.2%
500万(含)以上	每笔1000元

本基金的申购费用由申购人承担,主要用于市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金财产。

(2)赎回费

本基金A类基金份额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B类基金份额七日以内收取1.5%的赎回费,七日及七日以上不收取赎回费。

本基金A类基金份额的赎回费率表如下:

持有时间	费率
七日以内	1.5%
七日以(含七日)–两年以内	0.3%
两年以上(含两年)	0%

本基金B类基金份额的赎回费率表如下:

持有时间	费率
七日以内	1.5%
七日以(含七日)以上	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。对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费,基金管理人将其全额计入基金财产。对持续持有期长于7日的投资者,应当将不低于赎回费总额的25%计入基金财产,其余用于支付登记结算费和其他必要的手续费。

(3)基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整费率或收费方式调整申购费率和赎回费率,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,也可针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以特定交易方式(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。

2、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

本基金A类基金份额的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中,

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:

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/T日基金份额净值

申购份额的计算结果均按舍去尾数方法,保留到小数点后2位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。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,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例:某投资者当日申购本基金A类基金份额10万元,假设申购当日A类基金份额的基金份额净值为1.0260元,对应的本次前端申购费率为0.8%,该投资者可得到的A类基金份额为:

净申购金额＝100,000.00/(1+0.8%)＝99,206.35元

申购费用＝100,000.00－99,206.35＝793.65元

申购份额＝99,206.35/1.0260＝96,692.34份

即:投资者投资10万元申购本基金A类基金份额,假设申购当日A类基金份额的基金份额净值为1.0260元,可得到96,692.34份A类基金份额。

2)B类基金份额的申购份额计算方式

申购份额=申购金额/申购当日B类基金份额净值

申购份额的计算结果保留小数点后两位,两位以后舍去,舍去部分所代表的资产归基金财产所有。

(2)赎回金额的计算方式

1)A类基金份额的赎回金额计算方式

赎回总额=赎回份数×赎回当日A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

上述计算结果均按照四舍五入方法,保留小数点后两位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

投资者赎回10,000份基金份额,持有期限一年九个月,对应的赎回费率为0.3%,假设赎回当日基金份额净值是1.1615元,则其可得到的赎回金额为:

赎回总额=10,000×1.1615=11,615.00元

赎回费用=11,615.00×0.3%=34.85 元

赎回金额=11,615.00-34.85=11,580.16元

即:投资者赎回10,000份基金份额,持有期限一年九个月,对应的赎回费率为0.3%,假设赎回当日基金份额净值是1.1615元,则其可得到的赎回金额为11,580.16元。

2)B类基金份额的赎回金额计算方式

赎回金额=赎回份数×赎回当日B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

上述各计算结果赎回金额的计算结果按照四舍五入方法,保留小数点后两位,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。

(3)T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日公告。

A类基金份额净值=A类基金份额的基金资产净值/发售在外的A类基金份额总数

B类基金份额净值=B类基金份额的基金资产净值/发售在外的B类基金份额总数

遇特殊情况,可以适当延迟计算或公告,并报中国证监会备案。

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

十一、《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《华宝增强收益债券型证券投资基金招募说明书》作如下更新:

1、根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》更新了相关内容。

2、"三、基金管理人"更新了基金管理人的相关信息。

3、"四、基金托管人"更新了基金托管人的相关信息。

4、"五、相关服务机构"更新了代销机构的相关信息。

5、"九、与基金管理人管理的其他基金转换"更新了本基金与其他基金转换的相关内容。

6、"十、基金的投资"更新了截至2018年6月30日的基金的投资组合报告。

7、"十一、基金的业绩"更新了截至2018年6月30日的基金业绩数据。

8、"二十三、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
2018年9月27日