华宝高端制造股票型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

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:中国建设银行股份有限公司

【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会2014年10月24日证监许可【2014】1118号文注册,进行募集。

基金管理人保证《华宝高端制造股票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,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特有风险等其他风险。本基金是一只主动投资的股票型证券投资基金,属于证券投资基金中的预期风险和预期收益都较高的品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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》等信息披露文件,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,投资者认购(或申购)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12月10日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年9月30日,数据未经审计。

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2014年11月13日到2014年12月5日向个人投资者和机构投资者同时发售,《基金合同》于2014年12月10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,中国宝武钢铁集团有限公司产业金融党工委副书记、纪委书记,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、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、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

刘自强先生,复旦大学经济学硕士。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、投资副总监等职务,现任投资总监。2008年3月起任华宝动力组合混合型证券投资基金基金经理,2010年6月至2012年1月任华宝宝康消费品证券投资基金基金经理,2014年12月至2018年8月任华宝高端制造股票型证券投资基金基金经理,2015年5月起任华宝国策导向混合型证券投资基金基金经理,2016年11月起任华宝未来主导产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

贺喆,本科。曾在上海从容投资管理有限公司从事投资管理工作。2013年10月加入华宝基金管理有限公司,先后任高级分析师、基金经理助理等职务。2018年7月起任华宝转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2018年8月起任华宝高端制造股票型证券投资基金基金经理。

5、权益投资决策委员会成员

刘自强先生,投资总监、华宝动力组合混合型证券投资基金基金经理、华宝国策导向混合型证券投资基金基金经理、华宝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、华宝行业精选混合型证券投资基金基金经理、华宝收益增长混合型证券投资基金基金经理、华宝稳健回报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、华宝宝康消费品证券投资基金基金经理、华宝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,华宝先进成长混合型证券投资基金基金经理。

蔡目荣先生,国内投资部副总经理、华宝多策略增长开放式证券投资基金基金经理、华宝资源优选混合型证券投资基金基金经理、华宝价值发现混合型证券投资基金、华宝绿色主题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、编制中期和年度基金报告;
7、计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;
8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项;
9、召集基金份额持有人大会;
10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
11、以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
12、中国证监会规定的其他职责。

(四) 基金管理人承诺

1、基金管理人将遵守《基金法》、《证券法》、《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、基金管理人不从事下列行为:
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;
不公平地对待其管理的不同基金财产;
利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;
向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;
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、公司委托基金财产、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)基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:田国立
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:田青
联系电话:(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月,是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行,总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939),于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2018年6月末,本集团资产总额228,051.82亿元,较上年末增加6,807.99亿元,增幅3.08%。上半年,本集团盈利平稳增长,利润总额较上年同期增加93.27亿元至1,814.20亿元,增幅5.42%;净利润较上年同期增加84.56亿元至1,474.65亿元,增幅6.08%。

2017年,本集团先后荣获香港《亚洲货币》"2017年中国最佳银行",美国《环球金融》"2017最佳转型银行"、新加坡《亚洲银行家》"2017年中国最佳数字银行"、"2017年中国最佳大型零售银行奖"、《银行家》"2017最佳金融创新奖"及中国银行业协会"年度最具社会责任金融机构"等多项重要奖项。本集团在英国《银行家》"2017全球银行1000强"中列第2位;在美国《财富》"2017年世界500强排行榜"中列第28名。

中国建设银行总行设资产托管业务部,下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室,在安徽合肥设有托管运营中心,在上海设有托管运营中心上海分中心,共有员工315余人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

(二)主要人员情况

纪伟,资产托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职,并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历,熟悉各项托管业务,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部,长期从事客户服务、信贷业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玎,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行国际业务部,长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

(三)基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持"以客户为中心"的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2018年二季度末,中国建设银行已托管857只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》"中国最佳托管银行"、4次获得《财资》"中国最佳次托管银行"、连续5年获得中债登"优秀资产托管机构"等奖项,并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家"最佳托管银行"、在2017年荣获《亚洲银行家》"最佳托管系统实施奖"。

二、基金托管人的内部控制制度

(一)内部控制目标

作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

(二)内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作,具有独立行使内控合规工作职权和能力。

(三)内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理严格实行复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

三、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

(一)监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的"新一代托管应用监督子系统",严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,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开支情况进行检查监督。

(二)监督流程

1.每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统,对各基金投资运作比例控制等情况进行监控,如发现投资异常情况,向基金管理人进行风险提示,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,如有重大异常事项及时报告中国证监会。

2.收到基金管理人的划款指令后,对指令要素等内容进行核查。

3.通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求基金管理人进行解释或举证,如有必要将及时报告中国证监会。

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
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网上交易系统直销e网金办理本基金的申购、赎回、转换等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上交易网址:www.fsfund.com。

2、代销机构

(1)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: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: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

(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)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

(7)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

(8)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

(9)上海浦东发展银行股份有限公司

(10)深圳前海微众银行股份有限公司
办公地址:广东省深圳市南山区沙河西路1819号深圳湾科技生态园7栋A座
法定代表人:顾敏
客户服务电话:400-999-8800
公司网址:www.webank.com

(11)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

(12)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)
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

(13)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: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

(14)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: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

(15)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

(16)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/

(17)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

(18)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

(19)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

(20)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

(21)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:李晓皙
联系电话:95525
传真:021-22169134
客户服务电话:95525
公司网址:www.ebscn.com

(22)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
联系电话:95575
客户服务电话:95575
公司网址:www.gf.com.cn

(23)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
邮编:100007
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

(24)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:钟伟镇
传真:021-38670666
客户服务电话:95521
公司网址:www.gtja.com

(25)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
传真:0755-82133952
客户服务电话:95536
公司网址:www.guosen.com.cn

(26)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

(27)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

(28)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

(29)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

(30)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

(31)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

(32)华宝直销

(33)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

(34)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:马艺卿
传真:021-83387254
客户服务电话:95597
公司网址:www.htsc.com.cn

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

(36)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

(37)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

(38)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

(39)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

(40)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

(41)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

(42)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/

(43)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

(44)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
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

(45)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:021-962518
公司网址:www.962518.com

(46)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

(47)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

(48)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

(49)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

(50)上海挖财金融信息服务有限公司
客户服务电话:021-50810673
公司网址: www.wacaijijin.com

(51)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

(52)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

(53)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

(54)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

(55)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

(56)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

(57)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

(58)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

(59)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

(60)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

(61)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

(62)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

(63)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

(64)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

(65)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

(66)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

(67)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
联系电话:95548
传真:0532-85022605
客户服务电话:95548
公司网址:www.zxwt.com.cn

(68)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:上海市通力律师事务所
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:黎明、孙睿

(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:华宝高端制造股票型证券投资基金
基金类型:契约型开放式基金

六、基金的投资

(一)投资目标

把握制造业升级过程中的投资机会,在控制风险的前提下为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。

(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股票(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、资产支持证券、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(但须符合中国证监会相关规定)。

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。

基金的投资组合比例为:

本基金投资于股票的比例不低于基金资产的80%,其中,投资于高端制造业主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的80%;其余资产投资于现金、货币市场工具、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种,其中,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

(三)投资策略

1、大类资产配置策略

本基金采取积极的大类资产配置策略,通过宏观策略研究,综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、产业政策,以及市场流动性等方面因素,对相关资产类别的预期收益及风险进行动态跟踪,决定大类资产配置比例。

2、股票投资策略

本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法,通过对高端制造业主题相关行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析,挖掘该类型企业的投资价值,分享制造业升级过程中所带来的投资机会。

(1)高端制造业的界定

高端制造业是处于制造业价值链高端和产业链核心环节,是决定着整个产业链综合竞争力的战略性新兴产业,是推动工业转型升级的引擎。大力培育和发展高端制造业,是提升我国产业核心竞争力的必然要求,是抢占未来经济和科技发展制高点的战略选择,对于加快转变经济发展方式、实现由制造业大国向强国转变具有重要战略意义。

具体来说,本基金所指的高端制造业主要包括以下三个方面:

以生产具有较高附加值和高技术含量的重大先进工业设施设备机械为主的高端装备制造产业;

能够推动传统制造业向价值链高端延伸,且拥有先进技术、具有核心竞争力的传统制造业中的龙头企业;

其余发展战略符合制造业转型升级的政策方向,具备高技术含量、高附加值的制造业相关子行业。

随着未来经济结构的转变、产业结构的升级,从事或受益于上述投资主题的外延也将逐渐扩大,本基金将视实际情况调整上述高端制造业主题的界定。

(2)行业配置

高端制造业主题相关的各个行业由于所处的商业周期不同,面临的上下游市场环境也各不相同,其相关行业表现也并非完全同步。本基金将综合考虑经济周期、国家政策、社会经济结构、行业特性以及市场短期事件等方面因素,在不同行业之间进行资产配置。

(3)个股选择

本基金将对高端制造业主题相关上市公司分别进行系统地分析,运用定量与定性相结合的方法,综合分析其投资价值和成长能力,确定投资的股票,构建投资组合。

3、固定收益类投资工具投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要,将投资于债券、货币市场工具和资产支持证券,投资的目的是保证基金资产流动性,有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。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久期,并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。

4、其他金融工具投资策略

在法律法规许可的前提下,本基金可基于谨慎原则运用权证等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,提高投资效率,管理基金投资组合风险水平,以更好地实现本基金的投资目标。

(四)投资管理

1、决策依据

本基金主要依据下列因素决定基金资产配置和具体证券的买卖:
(1)国内外宏观经济环境及其对中国证券市场的影响;
(2)国家货币政策、产业政策以及证券市场政策;
(3)高端制造业主题上市公司的发展状况和实地调研结果;
(4)市场资金供求状况及未来走势;
(5)国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。

2、投资决策流程

(1)投资决策机制

公司的投资决策实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制,由基金经理根据投资决策委员会的授权具体承担基金投资管理工作。投资总监负责监督管理基金日常投资活动。公司投资决策机制为分级授权机制,即:

第一级,投资决策委员会。审定基金经理的投资组合配置提案和重点投资;

投资决策委员会是公司基金投资的最高决策机构,以定期或不定期(会议频率每月不少于一次)会议的形式讨论和决定基金投资的重大问题。

第二级,投资研究联席会议。确定投资组合配置提案。

研究部、投资管理部定期或不定期(会议频率双周一次或更多)召开投资-研究联席会议,研究、交流投资信息,探讨、解决投资业务的有关问题。双周投资-研究联席会议就研究部提交的全市场模拟组合与配置、宏观及行业策略,以及研究员提交的各行业模拟组合、三级股票池、重点投资品种等进行充分讨论。基金经理根据联席会议的成果及自身判断确定投资组合配置提案。

第三级,基金经理。在各自的权限内执行和优化组合配置方案。

(2)投资流程

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、资产配置做出决策。

2)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)、重大技术服务创新等,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。

3)基金经理小组负责投资执行

基金经理小组根据投资决策委员会的决议和行业发展,提出投资组合的资产配置比例建议,同时结合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的投资组合方案后,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。

4)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。

5)内部控制

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

(五)业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:申银万国制造业指数收益率×80% +上证国债指数收益率×20%。

申银万国制造业指数对制造行业股票具有较强的代表性,适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。

上证国债指数是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。它推出的目的是反映我们债券市场整体变动状况,是我国债券市场价格变化的"指示器"。

本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,与基金托管人协商一致后变更业绩比较基准,报中国证监会备案并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

(六)风险收益特征

本基金是一只主动投资的股票型基金,属于证券投资基金中的预期风险和预期收益都较高的品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

(七)投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)本基金投资于股票的比例不低于基金资产的80%,其中,投资于高端制造业主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的80%;
(2)保持不低于基金资产净值5%的现金(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;
(3)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%;
(4)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;
(5)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;
(6)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;
(7)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0.5%;
(8)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%;
(9)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%;
(10)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%;
(11)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%;
(12)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;
(13)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,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;
(14)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%;
(15)本基金总资产不得超过基金资产净值的140%;
(16)本基金持有其他基金投资基金(不含货币市场基金),其市值不得超过基金资产净值的10%;
(17)本基金投资流通受限证券,基金管理人应事先根据中国证监会相关规定,与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例,根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度,防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险;
(18)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述比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;
(19)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)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%;
(20)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;
(21)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除(2)、(12)、(18)、(20)项外,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比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。

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有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

2、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)违反规定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,但是中国证监会另有规定的除外;
(5)向其基金管理人、基金托管人出资;
(6)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;
(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

(八)基金管理人代表基金行使股东权利和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和债权人权利,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。

(九) 经基金管理人公告有关规则及事项,本基金可以依据法律法规的规定参与融资、融券。

(十)基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至2018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	336,856,704.97	86.35
	其中:股票	336,856,704.97	86.35
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	1,863,452.91	0.48
	其中:债券	1,863,452.91	0.48
	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	50,475,476.20	12.94
8	其他资产	894,721.00	0.23
9	合计	390,090,355.08	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	28,638,715.00	7.50
C	制造业	248,565,066.83	65.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,045,519.00	0.80
E	建筑业	9,438,408.00	2.47
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	1,131,220.00	0.30
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,089,075.00	1.59
J	金融业	32,626,012.14	8.54
K	房地产业	7,322,689.00	1.92
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	336,856,704.97	88.22

(2)报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资。

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	600104	上汽集团	459,600	15,295,488.00	4.01
2	600741	华域汽车	665,793	14,980,342.50	3.92
3	000063	中兴通讯	774,000	14,164,200.00	3.71
4	600028	中国石化	1,935,900	13,783,608.00	3.61
5	300429	强力新材	467,523	12,898,959.57	3.38
6	002690	美亚光电	576,100	12,731,810.00	3.33
7	600276	恒瑞医药	184,600	11,722,100.00	3.07
8	002152	广电运通	1,820,900	11,671,969.00	3.06
9	601628	中国人寿	512,700	11,628,036.00	3.05
10	002597	金禾实业	668,438	11,309,970.96	2.96

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债(可交换债)	1,863,452.91	0.49
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	1,863,452.91	0.49

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	128017	金禾转债	18,157	1,863,452.91	0.49

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。

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)高端制造基金截至2018年9月30日持仓前十名证券中的中兴通讯(000063)已与BIS达成《替代的和解协议》(以下简称"协议")以替代中兴通讯于2017年3月与BIS达成的《和解协议》。BIS已于2018年6月8日(美国时间)通过《关于中兴通讯的替代命令》(以下简称"2018年6月8日命令")批准协议立即生效。根据协议,中兴通讯将支付合计14亿美元民事罚款,包括在BIS签发2018年6月8日命令后60日内一次性支付10亿美元,以及在BIS签发2018年6月8日命令后90日内支付至由中兴通讯选择、经BIS批准的美国银行托管账户并在监察期内(定义见下文)暂缓的额外的4亿美元罚款(监察期内若中兴通讯遵守协议约定的监察条件和2018年6月8日命令,监察期届满后4亿美元罚款将被豁免支付)。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析,认为在中兴通讯在5G的龙头地位及中兴通讯新管理层到位后,中兴通讯已经具备中长期投资价值。

高端制造基金截至2018年9月30日持仓前十名证券中的中国人寿(601628)于2018年7月30日收到中国人民银行的处罚决定。因于2015年7月1日至2016年6月30日期间,未按照规定保存客户身份资料和交易记录以及未按照规定报送大额交易报告和可疑交易报告,公司被处以人民币70万元罚款。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析,认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响,因此本基金管理人对上述证券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八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	418,902.45
2	应收证券清算款	419,916.35
3	应收股利	–
4	应收利息	14,418.50
5	应收申购款	41,483.70
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	894,721.00

(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	128017	金禾转债	1,863,452.91	0.49

(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。

七、基金的业绩

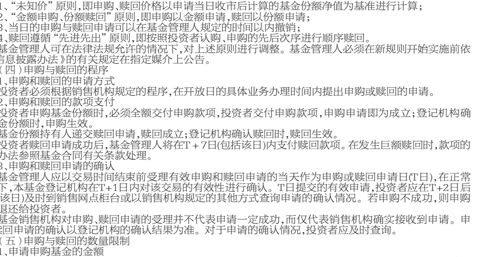
本基金业绩数据为截止2018年9月30日("报告期末")的数据,本报告中所列数据未经审计。

(一)净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
2014/12/10-2014/12/31	-0.30%	0.14%	-0.25%	1.54%	-0.05%	-1.40%
2015/01/01-2015/12/31	44.53%	2.91%	47.72%	2.32%	-3.19%	0.59%
2016/01/01-2016/12/31	-5.27%	2.14%	-11.82%	1.57%	6.55%	0.57%
2017/01/01-2017/12/31	-9.16%	0.92%	-0.94%	0.78%	-8.22%	0.14%
2018/01/01-2018/09/30	-15.48%	1.34%	-22.86%	1.19%	7.38%	0.15%
2014/12/10-2018/09/30	4.80%	1.99%	-0.72%	1.59%	5.52%	0.40%

(二)自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动的比较

累计份额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
(2014年12月10日至2018年9月30日)



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2015年6月10日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

八、基金份额的申购和赎回

(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。具体的销售机构参见本招募说明书"五、相关服务机构"部分相关内容或其他相关公告。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。基金投资者应当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份额的申购与赎回。

(二)申购与赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资者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。

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2015年2月10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。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的,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、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;
4、赎回遵循"先进先出"原则,即按照投资者认购、申购的先后次序进行顺序赎回。

基金管理人可在法律法规允许的情况下,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

投资者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。

2、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,申购申请即为成立;登记机构确认基金份额时,申购生效。

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,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。

3、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有效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,本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请,投资者应在T+2日后(包括该日)及时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。若申购不成功,则申购款项退还给投资者。

基金销售机构对申购、赎回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、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况,投资者应及时查询。

(五)申购与赎回的数量限制

1、申请申购基金的金额

通过其他销售机构和直销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每笔1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。各销售机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的,以各销售机构的业务规定为准。

其他销售机构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。

2、申请赎回基金的份额

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1份。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构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。

3、基金管理人可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、投资者每个基金交易账户的最低基金份额余额限制、单个投资者累计持有的基金份额上限、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等。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

4、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。

(六)申购费与赎回费

1、申购费

本基金采取前端收费模式收取基金申购费用。投资者可以多次申购本基金,申购费率按每笔申购申请单独计算。本基金的申购费率表如下:

申购金额	申购费率
500万(含)以上	每笔1000元
大于等于200万,小于500万	0.5%
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%

申购费用由投资者承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记费等各项费用。

2、赎回费

本基金的赎回费率随基金持有时间的增加而递减。本基金的赎回费率表如下:

持有基金份额期限	赎回费率(%)
小于7日	1.50%
大于等于7日,小于30日	0.75%
大于等于30日,小于1年	0.50%
大于等于1年,小于2年	0.25%
大于等于2年	0

注:此处一年按365日计算

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30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长于等于30日但少于3个月的投资者的赎回费,基金管理人将不低于其总额的75%计入基金财产。对于收取的持续持有期长于等于3个月但少于6个月的投资者的赎回费,基金管理人将不低于其总额的50%计入基金财产。对持续持有期长于6个月的投资者,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。

注:此处1个月按30日计算

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,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、赎回金额与基金份额净值的计算

1、申购份额的计算方式

本基金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/T日基金份额净值

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

申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值,有效份额单位为份,申购份额的计算结果均按舍去尾数方法,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。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资产承担。

例:假定T日基金份额净值为1.086元,某投资者当日投资10万元申购本基金,对应的本次前端申购费率为1.5%,该投资者可得到的基金份额为:
净申购金额=100000/(1+1.5%)=98522.17元
申购费用=100000-98522.17=1477.83元
申购份额=98522.17/1.086=90720.23份

即:投资者投资10万元申购本基金,假定申购当日基金份额净值为1.086元,可得到90720.23份基金份额。

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。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

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用,赎回金额单位为元。上述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:某投资者赎回本基金1万份基金份额,持有时间为两年三个月,对应的赎回费率为0%,假设赎回当日基金份额净值是1.150 元,则其可得到的赎回金额为:
赎回总额=10000×1.150=11500 元
赎回费用=11500×0%=0 元
赎回金额=11500-0=11500.00 元

即:投资者赎回本基金1万份基金份额,持有期限为两年三个月,假设赎回当日基金份额净值是1.150元,则其可得到的赎回金额为11,500.00元。

3、本基金份额净值的计算,保留到小数点后3位,小数点后第4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T日赎回基金成功后,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3个工作日在指定媒介上公告。

(九)拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时,基金管理人可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无法正常运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资者的申购申请。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。

3、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。

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,或基金管理人认定的其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。

7、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。

8、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。

9、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、6、9项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资者的申购申请时,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。如果投资者的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项将退还给投资者。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)暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时,基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项:

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项。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。

3、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。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、基金管理人认为继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时,可暂停接受投资者的赎回申请。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项时,基金管理人应在当日报中国证监会备案,已确认的赎回申请,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申请量占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。若出现上述第4项所述情形,按基金合同的相关条款处理。基金份额持有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:当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为因支付投资者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。

在单个基金份额持有人超过基金总份额20%以上的赎回申请情形下,本基金将按照以下规则实施延期办理赎回申请:若发生巨额赎回,存在单个基金份额持有人超过基金总份额20%以上("大额赎回申请人")的赎回申请情形,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。

(3)暂停赎回:连续2日以上(含本数)发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受基金的赎回申请;已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但不得超过20个工作日,并应当在指定媒介上进行公告。

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,同时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,基金管理人当日应立即向中国证监会备案,并在规定期限内在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。如发生暂停的时间超过1日,基金管理人可以按照《信息披露办法》的有关规定自行确定在指定媒介上刊登基金暂停公告的次数,并应于重新开放日,在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回的公告,并公告最近1个估值日的基金份额净值。

(十三)基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务,基金转换可以收取一定的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告,并提前告知基金托管人与相关机构。

(十四)基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、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者。

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登记机构的规定办理,并按基金登记机构规定的标准收费。

(十五)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。

(十六)定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划,具体规则由基金管理人另行规定。投资者在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额,每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

(十七)基金份额的冻结和解冻

基金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,以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

九、基金的费用

(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)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
(4)《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
(5)基金份额持有人大会费用;
(6)基金的证券交易费用;
(7)基金的银行汇划费用;
(8)基金的开户费用、账户维护费用;
(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。

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

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×1.5%÷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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

(2)基金托管人的托管费

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×0.25%÷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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支取,基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

(3)上述"1、基金费用的种类"中(3)到(8)项费用由基金托管人根据基金管理人指令按有关法规及相应协议的规定,列入当期基金费用。

4、不列入基金费用的项目
(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;
(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。

十、《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《华宝高端制造股票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"更新了本基金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"更新了本基金与其他基金转换的相关信息。
5、"十、基金的投资"更新了截至2018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2018年9月30日的基金业绩数据。
7、"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
2019年1月18日

华宝基金管理有限公司关于参加宜信普泽(北京)基金销售有限公司费率优惠活动的公告

根据华宝基金管理有限公司(以下简称"本公司")与宜信普泽(北京)基金销售有限公司(以下简称"宜信普泽")签署的《证券投资基金销售代理协议》,本公司将于2019年1月18日起参与宜信普泽费率优惠活动。现将有关事项公告如下:

一、适用投资者范围

通过宜信普泽申(认)购其代销本公司旗下的部分基金。具体以宜信普泽公告为准。

二、适用基金

序号	基金代码	基金简称
1	240001	华宝宝康消费品
2	240002	华宝宝康灵活配置
3	240003	华宝宝康债券
4	240004	华宝动力组合
5	240005	华宝多策略增长
6	240008	华宝收益增长
7	240009	华宝先进成长
8	240010	华宝行业精选
9	240011	华宝大盘精选
10	240012	华宝增强收益A
11	240014	华宝中证100
12	240016	华宝上证180价值ETF联接
13	240017	华宝新兴产业
14	240018	华宝可转债
15	240019	银行ETF联接A
16	240020	华宝医药生物
17	241001	华宝海外中国成长
18	240022	华宝资源优选
19	000124	华宝服务优选
20	000601	华宝创新优选
21	000612	华宝生态中国
22	000753	华宝量化对冲混合A
23	000866	华宝高端制造
24	162412	华宝中证医疗
25	162413	华宝中证1000
26	002634	华宝未来主导产业
27	003876	华宝沪深300
28	005445	华宝价值发现
29	005607	华宝中证500A
30	005883	华宝港股通香港
31	162411	华宝标普油气人民币
32	162414	华宝新机遇A
33	162415	华宝标普美国品质人民币
34	162416	华宝港股通恒生香港35
35	501021	华宝香港上市中国中小盘A
36	501029	华宝标普中国A股红利机会A
37	501301	华宝港股通恒生中国A

三、费率优惠活动内容

1、自2019年1月18日起,上述基金参与宜信普泽申(认)购费率优惠活动(只限前端收费模式),各基金具体折扣费率及费率优惠活动期限以宜信普泽的活动公告为准。优惠前申(认)购费率为固定费用的,则按原费率执行,不再享有费率折扣。

2、如本公司新增通过宜信普泽销售的基金,则自该基金在宜信普泽开放申(认)购之日起,将同时参与宜信普泽上述费率优惠活动,具体折扣费率及费率优惠活动期限以宜信普泽活动公告为准,本公司不再另行公告。

四、特别提示

1、上述费率优惠活动的解释权归宜信普泽基金所有,优惠活动期间,业务办理的相关规则及流程以宜信普泽基金的安排和规定为准。

2、投资者应认真阅读拟投资基金的《基金合同》、《招募说明书》等法律文件,了解所投资基金的风险收益特征,并根据自身情况购买与本人风险承受能力相匹配的产品。

五、投资者可通过以下途径咨询有关情况

1、宜信普泽(北京)基金销售有限公司
公司网址:http://www.yixinfund.com
客户服务电话: 400-6099-200
2、华宝基金管理有限公司
公司网址:www.fsfund.com
客户服务电话:4007005588、021-38924558

风险提示:基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资本公司旗下基金时应认真阅读基金的《基金合同》和《招募说明书》。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

华宝基金管理有限公司
2019年1月18日

华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加宜信普泽(北京)基金销售有限公司为代销机构的公告

根据华宝基金管理有限公司(以下简称"本公司")与宜信普泽(北京)基金销售有限公司(以下简称"宜信普泽")签署的《证券投资基金销售代理协议》,本公司自2019年1月18日起增加宜信普泽代理以下基金的销售业务,投资者可通过宜信普泽办理以下基金的开户、申购、赎回、定投、转换等相关业务。现将有关事项公告如下:

一、适用投资者范围

通过宜信普泽申(认)购其代销本公司旗下的部分基金。具体以宜信普泽公告为准。

二、适用基金

序号	证券代码	证券简称
1	162412	华宝中证医疗
2	162413	华宝中证1000
3	002111	华宝新起点
4	002634	华宝未来主导产业
5	003876	华宝沪深300
6	004335	华宝新飞跃
7	005125	华宝标普中国A股红利机会C
8	005445	华宝价值发现
9	005607	华宝中证500A
10	005608	华宝中证500C
11	005883	华宝港股通香港
12	162411	华宝标普油气人民币
13	162414	华宝新机遇A
14	162415	华宝标普美国品质人民币
15	162416	华宝港股通恒生香港35
16	501021	华宝香港上市中国中小盘A
17	501029	华宝标普中国A股红利机会A
18	501301	华宝港股通恒生中国A

三、定投业务提示

"定期定额投资业务"是指投资者通过基金管理人指定的销售机构申请,约定每月扣款时间、扣款金额、扣款方式,由指定销售机构于每期约定扣款日,在投资者指定银行账户内自动完成扣款和基金申购申请的一种长期投资方式。销售机构将按照与投资者申请时所约定的每月固定扣款日、扣款金额扣款,若遇非基金交易日时,扣款是否顺延以销售机构的具体规定为准。

四、特别提示

投资者应认真阅读拟投资基金的《基金合同》、《招募说明书》等法律文件,了解所投资基金的风险收益特征,并根据自身情况购买与本人风险承受能力相匹配的产品。

五、投资者可通过以下途径咨询有关情况

1、宜信普泽(北京)基金销售有限公司
公司网址:http://www.yixinfund.com
客户服务电话: 400-6099-200
2、华宝基金管理有限公司
公司网址:www.fsfund.com
客户服务电话:4007005588、021-38924558

风险提示:基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资本公司旗下基金时应认真阅读基金的《基金合同》和《招募说明书》。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

华宝基金管理有限公司
2019年1月18日