华宝兴业可转债债券型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

2014年第2号

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

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《华宝兴业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》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人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。

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

本招募说明书根据2014年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》进行了部分更新。本招募说明书摘要所载内容截止日为2014年10月27日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2014年9月30日，财务数据未经审计。

一、基金合同生效日

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：华宝兴业基金管理有限公司
住所：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心58楼
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58楼
法定代表人：郑安国
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：韩东霞

股权结构：中方股东华宝信托有限责任公司持有51%的股份，外方股东领先资产管理有限公司持有49%的股份。

（二） 主要人员情况

1、董事会成员

郑安国先生，董事长、博士、高级经济师。曾任南方证券有限公司发行部经理、投资部经理、南方证券有限公司投资银行部总经理助理、南方证券有限公司上海分公司副总经理、南方证券公司研究所总经理级副所长、华宝信托投资有限责任公司副总经理、总经理、总裁。现任华宝兴业基金管理有限公司董事长、华宝信托有限责任公司董事长、华宝投资有限公司董事、总经理，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月加入华宝兴业基金管理有限公司，曾任公司营运总监、董事会秘书、副总经理，现任公司总经理。

Lionel PAQUIN先生，董事，硕士。曾在法国财政部、法国兴业银行、领先资产管理有限公司从事监察、风险管理和专户平台等业务，现任领先资产管理有限公司总裁。

Alexandre Werno先生，董事，硕士。曾在法兴集团从事内审监察及国际业务战略风险管理工作；曾任法国兴业银行全球市场执行董事、中国业务发展负责人。2013年5月加入华宝兴业基金管理公司任总经理高级顾问。现任公司常务副总经理。

张群先生，独立董事，博士、教授、博导。曾任北京科技大学经济管理学院（现东凌经济管理学院）教授、院长。现任北京科技大学东凌经济管理学院教授、学术委员会副主席，管理科学研究所所长。

罗飞先生，独立董事，博士、教授、博导。曾任中南财经政法大学会计系讲师、会计系西方会计研究室主任、会计系副主任、会计学院院长。现任中南财经政法大学经济与会计监管中心主任。

江岩女士，独立董事，法学学士、工商管理硕士。曾任中国政法大学教师、深圳市轻工集团公司法律秘书、南方证券股份有限公司深圳总部总经理、国际业务总部总经理助理、总经理。现任北京竞天公诚律师事务所律师。

（2）监事会成员

Anne MARION－BOUCHACOURT女士，监事，硕士。曾任普华永道总监，杰米尼咨询金融机构业务副总裁，索尔文国际副总裁，法兴集团人力资源高级执行副总裁兼执行委员会委员。现任法兴集团中国区负责人，集团管理委员会委员。

贾璐女士，监事，硕士，高级工程师。曾任宝钢自动化部组干科主办，宝钢国贸公司人事部人才开发室主任，宝钢国际公司人力资源部部长、组织部部长，宝钢资源（国际）公司总经理助理。现任华宝投资公司副总经理，宝钢集团金融系统党委副书记。

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，现任公司营运副总监。

（3）总经理及其他高级管理人员

郑安国先生，董事长，简历同上。

HUANG Xiaoyi Helen（黄小薏）女士，总经理，简历同上。

Alexandre Werno先生，常务副总经理，简历同上。

任志强先生，副总经理，硕士。曾任南方证券有限公司上海分公司研究部总经理助理、南方证券研究所综合管理部副经理，华宝信托投资责任有限公司发展研究中心总经理兼投资管理部总经理，华宝信托投资责任有限公司总裁助理兼董事会秘书，华宝证券经纪有限公司董事、副总经理。2007年8月加入华宝兴业基金管理有限公司，曾任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理。现任华宝兴业基金管理有限公司副总经理兼投资总监。

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年加入华宝兴业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。现任华宝兴业基金管理有限公司督察长。

2、本基金基金经理

王瑞海先生，曾在深圳中大投资管理公司、海南证券北京营业部、太平人寿保险有限公司、太平资产管理有限公司从事投资管理、股票自营和固定收益投资研究工作。2012年7月加入华宝兴业基金管理有限公司，任固定收益部总经理，2013年4月2014年10月兼任华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理，2014年5月起兼任华宝兴业可转债债券型证券投资基金基金经理，2014年2月至2014年5月兼任华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金基金经理，2014年5月兼任华宝兴业活期通货币市场基金基金经理。

3、固定收益投资决策委员会成员

任志强先生，副总经理、投资总监。

王瑞海先生，固定收益部总经理、华宝兴业活期通货币市场基金、华宝兴业可转债债券型证券投资基金基金经理。

李栋梁先生，华宝兴业宝康债券投资基金基金经理、华宝兴业增强收益债券型证券投资基金。

陈昕先生，华宝兴业现金宝货币市场基金、华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金经理。

（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》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）监控与检查。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、建立完善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：252.198亿元
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—83077301
传真：0755—83195201
资产托管部信息披露负责人：朱万鹏

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。截止2014年9月30日，本集团总资产5.0331万亿元人民币，高级法下资本充足率11.45%，权重法下资本充足率10.89%。

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，下设业务支持室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室5个职能处室，现有员工60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）、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，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。

经过十年发展，招商银行资产托管规模快速壮大。2013年招商银行加大高收益托管产品营销力度，新增托管公募开放式基金18只，新增首发公募开放式基金托管规模377.37亿元。克服国内证券市场震荡下行的不利形势，托管费收入、托管资产均创出历史新高，实现托管费收入10.62亿元，较上年增长62.47%，托管资产余额1.86万亿元，较年初增长71.86%。作为公益慈善基金的首个独立第三方托管人，成功签约"壹基金"公益慈善基金托管，为我国公益慈善资金监管、信息披露进行有益探索，该项目荣获2012中国金融品牌「金象奖」"十大公益项目"奖；四度蝉联获《财资》"中国最佳托管专业银行"。

（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。

丁伟先生，本行副行长。大学本科毕业，副研究员。1996年12月加入本行，历任杭州分行办公室主任兼营业部总经理，杭州分行行长助理、副行长，南昌支行行长，南昌分行行长，总行人力资源部总经理，2008年4月起任本行副行长。兼任招银国际金融有限公司董事长。

吴晓辉先生，招商银行资产托管部总经理，硕士研究生，高级经济师。1993年10月进入招商银行工作；历任招商银行总行计划资金部副总经理，招商银行总行资金交易部总经理、招银国际金融有限公司总裁；招商银行济南分行党委书记、行长，2011年7月起担任招商银行总行资产托管部总经理。

（三）基金托管业务经营情况

截至2014年9月30日，招商银行股份有限公司托管了招商安泰系列证券投资基金（含招商股票证券投资基金、招商平衡型证券投资基金和招商债券证券投资基金），招商现金增值开放式证券投资基金、华夏经典配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深300指数证券投资基金、华夏货币市场基金、光大保德信货币市场基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、光大保德信新增长股票型证券投资基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、德盛优势股票证券投资基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、光大保德信优势配置股票型证券投资基金、益民多利债券型证券投资基金、德盛红利股票证券投资基金、上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金、上投摩根行业轮动股票型证券投资基金、中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金、南方策略优化股票型证券投资基金、兴全合润分级股票型证券投资基金、中邮核心主题股票型证券投资基金、长盛沪深300指数证券投资基金（LOF）、中银价值精选灵活配置混合型证券投资基金、中银稳健双利债券型证券投资基金、银河创新成长股票型证券投资基金、嘉实多利分级债券型证券投资基金、国泰保本混合型证券投资基金、华宝兴业可转债债券型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、诺安保本混合型证券投资基金、鹏华新兴产业股票型证券投资基金、博时裕祥分级债券型证券投资基金、上证国有企业100交易型开放式指数证券投资基金、华安可转换债券债券型证券投资基金、中银转债增强债券型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、中银中小盘成长股票型证券投资基金、国泰成长优选股票型证券投资基金、兴全轻资产投资股票型证券投资基金（LOF）、易方达纯债债券型证券投资基金、中银沪深 300 等权重指数证券投资基金(LOF)、中银保本混合型证券投资基金、嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信14天理财债券型发起式证券投资基金、鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中银纯债债券型证券投资基金、南方安心保本混合型证券投资基金、中银理财7天债券型证券投资基金、中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、中银理财30天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、中银稳健添利债券型发起式证券投资基金、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金、工银瑞信增利分级债券型证券投资基金、鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金、中银消费主题股票型证券投资基金、工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信保本3号混合型证券投资基金、中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金、博时月月薪定期支付债券型证券投资基金、中银聚利分级债券型证券投资基金、国泰金龙回报两年定期开放债券型证券投资基金、中海惠利纯债分级债券型证券投资基金、富国恒利分级债券型证券投资基金、中银优秀企业股票型证券投资基金、中银多策略灵活配置混合型证券投资基金、华安新活力灵活配置混合型证券投资基金、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金、交银施罗德新成长股票投资基金、嘉实对冲套利定期开放混合型证券投资基金、宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金和银华永益分级债券型证券投资基金、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信新财富灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金、中银新经济灵活配置混合型证券投资基金共85只开放式基金及其它托管资产，托管资产为29520.42亿元人民币。

（四） 托管人的内部控制制度

1.内部控制目标

确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，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完整；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：

一级风险防范是在总行层面对风险进行预防和控制。

二级防范是总行资产托管部设立稽核监察室，负责部门内部风险预防和控制。稽核监察室在总经理室直接领导下，独立于部门内其他业务室和托管分部、分行资产托管业务主管部门，对各岗位、各业务室、各分部、各项业务中的风险控制情况实施监督，及时发现内部控制缺陷，提出整改方案，跟踪整改情况。

三级风险防范是总行资产托管部在专业岗位设置时，必须遵循内控制衡原则，监督制衡的形式和方式视业务的风险程度决定。

3.内部控制原则

（1）全面性原则。内部控制应覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有室和岗位，并由全部人员参与。

（2）审慎性原则。内部控制的核心是有效防范各种风险，托管组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点，应当体现"内控优先"的要求。

（3）独立性原则。各室、各岗位职责应当保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间应当分离。内部控制的检查、评价部门应当独立于内部控制的建立和执行部门，稽核监察室应保持高度的独立性和权威性，负责对部门内部控制工作进行评价和检查。

（4）有效性原则。内部控制应当具有高度的权威性，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应当能够得到及时的反馈和纠正。

（5）适应性原则。内部控制应适应我行托管业务风险管理的需要，并能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。内部控制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相应的修订和完善。

（6）防火墙原则。业务营运、稽核监察等相关室，应当在制度上和人员上适当分离，办公网和业务网分离，部门业务网和全行业务网分离，以达到风险防范的目的。

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

（8）制衡性原则。内部控制应当在托管组织体系、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。

（9）成本效益原则。内部控制应当权衡托管业务的实施成本与预期效益，以适当的成本实现有效控制。

4.内部控制措施

（1）完善的制度建设。招商银行资产托管部制定了《招商银行证券投资基金托管业务管理办法》、《招商银行资产托管业务内控管理办法》、《招商银行基金托管业务操作规程》和等一系列规章制度，从资产托管业务操作流程、会计核算、岗位管理、档案管理、保密管理和信息管理等方面，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。为保障托管资产安全和托管业务正常运作，切实维护托管业务各当事人的利益，避免托管业务危机事件发生或确保危机事件发生后能够及时、准确、有效地处理，招商银行还制定了《招商银行托管业务危机事件应急处理办法》，并建立了灾难备份中心，各种业务数据能及时在灾难备份中心进行备份，确保灾难发生时，托管业务能迅速恢复和不间断运行。

（2）经营风险控制。招商银行资产托管部托管项目审批、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、差错处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采用加密方式传输数据。数据执行异地同步灾备，同时，每日定时对托管业务数据进行磁带备份，托管业务数据进行磁带备份，所有的业务信息须经过严格的授权才能进行访问。

（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、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队及人才储备机制，有效的进行人力资源控制。

（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》、《证券投资基金运作管理办法》等有关证券法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金管理人参与银行间债券市场、基金管理人选择存款银行、基金资产净值计算、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的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人对上述事项的监督与核查中发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述监督内容的约定和其他有关法律法规的规定，应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规允许的投资比例调整期限。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。在规定时间内，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的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人限期改正，如基金管理人未能在通知期限内纠正的，基金托管人应向中国证监会报告。

基金管理人有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，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

本公司在上海开设直销柜台。
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58楼
邮政编码：200120
直销柜台电话：021－38505731，38505732，021－38505888－301或302
直销柜台传真：021－50499663，50988055

（2）直销e网金

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

2、代销机构：

（1）招商银行股份有限公司
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
法定代表人：李建红
联系人：邓炯鹏
联系电话：0755－83198888
公司网址： www.cmbchina.com
客户服务电话： 95555

（2）中国银行股份有限公司
住所：北京市复兴门内大街1号
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
法定代表人：田国立
客户服务电话：95566
网址：www.boc.cn

（3）中国建设银行股份有限公司
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：王洪章
客户服务电话：95533
网址：www.ccb.com

（4）中国工商银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
客户服务电话：95588
网址：www.icbc.com.cn

（5）交通银行股份有限公司
注册地址：上海市银城中路188号
办公地址：上海市银城中路188号
法定代表人：牛锡明
电话：（021）58781234
传真：（021）58408483
联系人：曹榕
客户服务电话：95559
网址：www.bankcomm.com

（6）中国民生银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：洪崎
联系电话：010－58560666
传真：010－57092611
联系人：杨成茜
客户服务电话：95568
公司网址：www.cmbc.com.cn

（7）中信银行股份有限公司
法定代表人：常振明
注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
24小时客户服务热线：95558
网址：bank.ecitic.com

（8）平安银行股份有限公司
地址：深圳市深南东路5047号
法定代表人： 孙建一
联系人：张莉
联系电话：021－38637673
传真电话：021－50979507
客户服务电话：95511－3
公司网址： bank.pingan.com

（9）上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：中国·上海市中山东一路12号
法定代表人：吉晓辉
联系人：高天、姚磊
电话：021－61618888
传真：021－63604196
客户服务热线：95528
公司网址：www.spdb.com.cn

（10）兴业银行股份有限公司
注册地址：福州市湖东路154号中山大厦
法定代表人：高建平
网址：http://www.cib.com.cn
客户服务电话：95561 或拨打各城市营业网点咨询电话

（11）江苏银行股份有限公司
住所：南京市洪武北路55号
法定代表人：黄志伟
网址：www.jsbchina.cn
客户服务电话：96098，40086－96098

（12）渤海银行股份有限公司
办公地址：天津市河西区马场道 201－205 号
法定代表人：刘宝凤
网址：www.cbhb.com.cn
客户服务电话：400 888 8811

（13）国泰君安证券股份有限公司
注册地址：上海浦东新区商城路618号
法定代表人：万建华
电话：021－38676666
传真：021－38670666
联系人：芮敏祺
服务热线：400－8888－666
公司网站：www.gtja.com

（14）光大证券股份有限公司
注册地址：上海市静安区新闸路1508 号
办公地址：上海市静安区新闸路1508 号
法定代表人：薛峰
联系人： 刘晨、李芳芳
电话：021－22169999
传真：021－22169134
客户服务热线：95525、4008888788、10108998
公司网址：www.ebscn.com

（15）海通证券股份有限公司
注册地址：上海市淮海中路98号
法定代表人：王开国
电话：021－23219000
服务热线：95553、400－8888－001或拨打各城市营业网点咨询电话
联系人：李笑鸣
公司网址：www.htsec.com

（16）中国银河证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人：陈有安?
客户服务电话：400－8888－888
电话：010－66568450
联系人：宋明
公司网址：www.chinastock.com.cn

（17）中信建投证券股份有限公司
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：王常青
电话：400－8888－108(免长途费)
联系人：权唐
公司网址：www.csc108.com

（18）招商证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座39—45层
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座39—45层
法定代表人：宫少林
电话：0755－82943666
联系人：林生迎
客户服务热线：4008888111、95565
公司网址：www.newone.com.cn

（19）广发证券股份有限公司
法定代表人：孙树明
注册地址：广州天河区天河北路183－187号大都会广场43楼（4301－4316房）
办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
联系人：黄岚
统一客户服务热线：95575或致电各地营业网点
公司网站：广发证券网 http://www.gf.com.cn

（20）长江证券股份有限公司
住所：武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：杨泽柱
电话：027－65799999
传真：027－85481900
联系人：李良
客户服务热线：95579或4008－888－999
公司客服网址：www.95579.com

（21）东吴证券股份有限公司
注册地址：苏州工业园区翠园路181号商旅大厦
法定代表人：范力
联系人：方晓丹
电话：0512－65581136
传真：0512－65588021
客服电话：0512－33396288
网址：http://www.dwzq.com.cn

(22) 华泰证券股份有限公司
住所：南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
电话：025－57038523
?传真：025－84579763
?联系人：彭长泉
公司网址：www.htsc.com.cn
客户服务热线：95597

(23) 申银万国证券股份有限公司
注册地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场40层
法定代表人：储晓明??
电话：021－33389888
传真：021－33388224
客服电话：95523或4008895523
电话委托：021－962505
网址：www.sywg.com

（24）平安证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16－20层；
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：谢永林
联系人：郑舒丽
全国免费业务咨询电话：95511－8
开放式基金业务传真：0755－82400862
公司网址： http://www.pingan.com

（25）中信证券股份有限公司
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）
法定代表人：王东明
电话：010－60838888
传真：010－60833739
联系人：顾凌
客户服务电话：95548
公司网址：www.cs.ecitic.com

（26）东方证券股份有限公司
注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层－29层
法定代表人：潘鑫军
联系人：胡月茹
电话：021－63325888
传真：021－63326729
客户服务热线：95503
公司网站：www.dfzq.com.cn

（27）兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路268号
法定代表人：兰荣
电话：0591－38162212
联系人：黄英
客户服务热线：95562
公司网站：www.xyzq.com.cn

（28）中信证券（浙江）有限责任公司
注册地址：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
办公地址：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
法定代表人：沈强
客户服务热线：95548
公司网址：www.bigsun.com.cn

（29）国信证券股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16楼至26楼
法定代表人：何如
联系人：周杨
电话：0755－82130833
传真：0755－82133952
客户服务热线：95536
国信证券网站：www.guosen.com.cn

（30）中信证券（山东）有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人：杨宝林
基金业务联系人：吴忠超
电话：0532－85022326
传真：0532－85022605
客户咨询电话：95548
公司网址：www.citicssd.com

（31）华宝证券有限责任公司
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
法定代表人：陈林
邮政编码：200120
客服热线：400－820－9898，021－38929908
总部总机电话：021－68777222
传真：021－68777822
公司网站： http://www.cnhbstock.com

（32）中银国际证券有限责任公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法定代表人：许刚
咨询电话：4006208888或各地营业网点咨询电话
网址：www.bocichina.com
传真：021－50372474

（33）恒泰证券股份有限公司
注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号邮编010010
办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号邮编010010
法定代表人：庞介民
联系人：王旭华
联系电话：0471－4972343
网址：www.cnht.com.cn

（34）长城证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：黄耀华
联系人：高峰
电话：0755－83516094
传真：0755－83515567
客户服务热线：?? 0755－33680000、400 6666 888?
公司网址：www.cgws.com

（35）渤海证券股份有限公司
注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
法定代表人：杜庆平
联系人：胡天彤
电话：022－28451709
传真：022－28451958
客户服务电话：4006515988
网址：http://www.bhzq.com

（36）中国中投证券有限责任公司
?住所：深圳福田区益田路6003号荣超商务中心A座18－21层
法定代表人： 龙增来
联系电话：0755－82023442
传真：0755－82026539
联系人：刘毅
?客服电话：400 600 8008、95532
网址：www.china－invs.cn

（37）国元证券股份有限公司
注册地址：合肥寿春路179号
法人代表：凤良志
客户服务热线：4008888777或95578
公司网址：www.gyzq.com.cn

（38）安信证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼
法定代表人： 牛冠兴
联系电话：0755－82558323
传真：0755－82558355
联系人：余江
客服电话：4008－001－001
公司网址：www.essence.com.cn

（39）中国国际金融有限公司
住所：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：丁学东
基金代销业务联系人：罗春蓉 、陈曦、康楠?
联系电话：010－65051166
传真：010－65058065

(40)民生证券有限责任公司
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16－20层
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
法定代表人：余政
联系人：赵明
联系电话：010－85127622
联系传真：010－85127917
网址：www.mszq.com
客户服务电话：4006198888

（41）齐鲁证券有限公司
注册地址：山东省济南市市中区经七路86号
办公地址：山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人：李玮
联系人：吴阳
电话：0531－68889155
传真：0531－68889752
客服电话：95538
网址：www.qlzq.com.cn

（42）华福证券有限责任公司
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
客服电话：96326（福建省外请加拨0591）
公司网址：www.hfzq.com.cn

（43）信达证券股份有限公司
办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院1 号楼信达金融中心
联系人：唐静
联系电话：010－63081000
传真：010－63080978
客服电话：400－800－8899
公司网址：www.cindasc.com

（44）江海证券有限公司
注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：孙名扬
联系人：张背北
电话：0451－85863696
传真：0451－82287211
客户服务热线：400－666－2288
网址：www.jhzq.com.cn

（45）国都证券有限责任公司
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
法定代表人：常喆
客户服务电话：400－818－8118
网址：www.guodu.com

（46）东北证券股份有限公司
注册地址：长春市自由大路1138号
办公地址：长春市自由大路1138号
法定代表人：杨树财
电话：0431－85096517
传真：0431－85096795
客服电话：4006000686
网址：www.nesc.cn

（47）德邦证券有限责任公司
名称：德邦证券有限责任公司
住所：上海市普陀区曹阳路510号南半幢9楼
办公地址：上海市福山路500号城建国际中心26楼
邮政编码：200122
注册资本：16.9亿元人民币
法定代表人：姚文平
联系人：朱磊
联系电话：862168761616－8507
传真：862168767981

（48）华安证券股份有限公司
注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座
法定代表人：李工
公司电话：0551－65161666
传真：0551－65161600
网址：www.hazq.com
客户服务电话： 96518（安徽）、400－80－96518（全国）

（49）上海证券有限责任公司
注册地址：上海市西藏中路336号
办公地址：上海市西藏中路336号
法定代表人：龚德雄
联系人：许曼华
电话：021－53519888
传真：021－53519888
网址：www.962518.com
客户服务电话：4008918918、021－962518

（50）东海证券股份有限公司
注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层
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：朱科敏
电话：021－20333333
传真：021－50498825
客服电话：95531；400－8888－588
网址：www.longone.com.cn

（51）中航证券有限公司
注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
法定代表人：王宜四
联系人：戴蕾
联系电话：0791－86768681
客服电话：400－8866－567
公司网址：www.avicsec.com

（52）山西证券股份有限公司
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
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
联系人：郭熠
联系电话：0351－8686659
传真：0351－8686619
客户服务电话：400－666－1618、95573
公司网址：www.i618.com.cn

（53）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址：上海杨浦区秦皇岛路32号C栋 2楼
法定代表人：汪静波
联系人：方成
联系电话：021－38609777
公司网址：www.noah－fund.com
客户服务电话： 400－821－5399

(54)、深圳腾元基金销售有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806－1810
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
业务联系人：鄢萌莎
联系电话：0755－33376922
公司网址：www.tenyuanfund.com
客户服务电话：4006－877－899

(55)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
法定代表人： 王莉
电话： 021－20835788
传真：021－20835879
客户服务电话：400－920－0022
公司网址：licaike.hexun.com

(56)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址： 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
邮政编码：518028
注册资本：2000万元人民币
法定代表人： 杨懿
电 话：010－58325395
传 真：010－58325282
客户服务电话：400－850－7771
网址：8.jrj.com.cn

(57)深圳众禄基金销售有限公司
注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
邮政编码：518001
注册资本：2000万
法定代表人：薛峰
电 话：0755－33227950
传 真：0755－33227951
公司网址：www.zlfund.cn ；www.jjmmw.com
客服热线：4006－788－887

(58)杭州数米基金销售有限公司
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
邮政编码：310053
注册资本：5000万元人民币
法定代表人：陈柏青
电 话：0571－28829790，021－60897869
传 真：0571－26698533
客服热线：4000－766－123
公司网址：http://www.fund123.cn/

(59) 上海天天基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼
邮政编码：200127
注册资本：人民币伍仟万元
法定代表人：其实
电 话：021－54509998
传 真：021－64385308
公司网址：www.1234567.com.cn
客户服务电话：400－1818－188

(60)浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
法定代表人：凌顺平
电话：0571－88911818
传真：0571－88910240
网址：www.5ifund.com
客服：4008－773－772

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：华宝兴业基金管理有限公司（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有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1233 号汇亚大厦1604－1608 室
办公地址：中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
法定代表人：杨绍信
联系电话：(021) 23238888
传真：(021) 23238800
联系人：刘颖
经办注册会计师：汪棣、刘颖

五、基金的名称

本基金名称：华宝兴业可转债债券型证券投资基金

六、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

七、基金的投资目标

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。

八、基金的投资范围

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%。

九、基金的投资策略

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，以获取股票上涨所带来的收益。

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收益率变化、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、发行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、赎税条件、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。本基金将通过深入分析资产支持证券的资产构成及质量、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），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）量化投资部负责投资数量分析模型

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，包括总体资产配置、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解。

（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。

十、基金的业绩比较基准

中信标普可转债指数收益率×70% +上证国债指数收益率×30%。

中信标普可转债指数由中信标普指数公司推出，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。

十一、基金的风险收益特征

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。

十二、基金的投资组合报告

本基金的投资组合报告所载的数据截至2014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	30,727,500.00	6.76
	其中：股票	30,727,500.00	6.76
2	固定收益投资	417,697,749.67	91.96
	其中：债券	417,697,749.67	91.96
	资产支持证券	－	－
3	贵金属投资	－	－
4	金融衍生品投资	－	－
5	买入返售金融资产	－	－
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	－	－
6	银行存款和结算备付金合计	2,762,609.25	0.61
7	其他资产	3,041,912.59	0.67
8	合计	454,229,771.51	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

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	－	－
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	30,727,500.00	9.63
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	－	－
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	30,727,500.00	9.63

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	000099	中信海直	2,550,000	30,727,500.00	9.63

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	1,018.00	0.00
2	央行票据	－	－
3	金融债券	17,008,500.00	5.33
	其中：政策性金融债	17,008,500.00	5.33
4	企业债券	1,014.20	0.00
5	企业短期融资券	－	－
6	中期票据	－	－
7	可转债	400,687,217.47	125.57
8	其他	－	－
9	合计	417,697,749.67	130.90

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	110022	同仁转债	545,920	68,354,643.20	21.42
2	113003	重工转债	408,000	55,830,720.00	17.50
3	110015	石化转债	469,000	51,135,070.00	16.02
4	113005	平安转债	379,000	41,481,550.00	13.00
5	110023	民生转债	410,720	38,426,963.20	12.04

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）石化转债发行人中国石化2014 年1 月13 日发布公告：国务院对山东省青岛市"11·22"中石化东黄输油管道泄漏爆炸特别重大事故调查处理报告已作出批复，同意国务院事故调查组的调查处理结果，对中国石化及当地政府的48名责任人分别给予纪律处分，对涉嫌犯罪的15名责任人移送司法机关依法追究法律责任。根据国务院事故调查组的统计，本次事故造成直接经济损失人民币75,172万元，公司将承担其相应赔偿责任。

平安转债发行人中国平安2013年10月14日公告其控股子公司平安证券有限责任公司（以下简称"平安证券"）近日收到《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》（(2013)48号）。中国证券监督管理委员会决定责令平安证券改正及给予警告，没收其在万福生科（湖南）农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元，并处以人民币5,110万元的罚款，暂停其保荐业务许可3个月。

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，认为该处罚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可转债的投资判断未发生改变。

本报告期内，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	196,265.63
2	应收证券清算款	232,150.24
3	应收股利	－
4	应收利息	2,412,408.45
5	应收申购款	201,088.27
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	3,041,912.59

（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	110022	同仁转债	68,354,643.20	21.42
2	113003	重工转债	55,830,720.00	17.50
3	110015	石化转债	51,135,070.00	16.02
4	113005	平安转债	41,481,550.00	13.00
5	110023	民生转债	38,426,963.20	12.04
6	128004	久立转债	28,304,320.00	8.87
7	110020	南山转债	18,412,261.50	5.77
8	113002	工行转债	16,767,068.70	5.25
9	128002	东华转债	16,712,581.69	5.24
10	110011	歌华转债	15,993,825.00	5.01
11	128003	华天转债	13,648,436.48	4.28
12	110024	隧道转债	11,769,856.00	3.69
13	110017	中海转债	7,888,800.00	2.47
14	127002	徐工转债	6,430,761.70	2.02
15	113001	中行转债	3,106,800.00	0.97

（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。

十三、基金的业绩

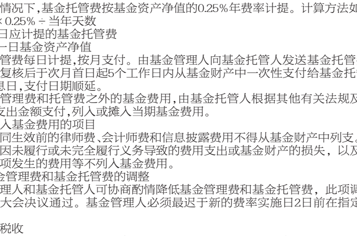
基金业绩截止日为2014年9月30日，所列数据未经审计。

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%
2014/01/01-2014/09/30	4.78%	0.80%	7.85%	0.33%	-3.07%	0.47%
2011/04/27-2014/09/30	2.30%	0.70%	3.81%	0.37%	-1.51%	0.33%

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：

华宝兴业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2014年9月30日）



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。

十四、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）基金财产拨划支付的银行费用；
（4）基金合同生效后的基金信息披露费用；
（5）基金份额持有人大会费用；
（6）基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
（7）基金的证券交易费用；
（8）依法可以在基金财产中列支的其他费用。

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

3、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，基金管理费按基金资产净值的1.3%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×1.3%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5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、休息日，支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按基金资产净值的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为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

（3）除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

4、不列入基金费用的项目

基金合同生效前的律师费、会计师费和信息披露费用不得从基金财产中列支。基金管理人与基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

5、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

6、基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

（二）与基金有关的销售费用

1、申购费与赎回费

1）本基金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	0.2%
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%

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。

2）本基金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。本基金的赎回费率表如下：

持有时间	赎回费率
两年以内	0.5%
两年以上(含两年)	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。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。

3）基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整申购费率或收费方式，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体上公告。

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。

2、申购份额与赎回金额的计算方式

1）申购份额的计算

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

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，可得到37,103.82份基金份额。

2）赎回金额的计算

本基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用。其中，
赎回总额=赎回份额×赎回当日基金份额净值
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份基金份额，T日本基金份额净值为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份基金份额，可得到净赎回金额2172.48元。

十五、《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》)、《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，华宝兴业基金管理有限公司对《华宝兴业可转债债券型证券投资基金招募说明书》作如下更新：

1、"三、基金管理人"部分，更新了基金管理人的相关信息。
2、"四、基金托管人"部分，更新了基金托管人的相关信息。
3、"五、相关服务机构"部分，更新了"一、基金份额发售机构"中代销机构的相关信息。
4、"七、基金合同生效"部分，更新了基金合同生效后的相关条款。
5、"九、与基金管理人管理的其它基金转换"部分，更新了办理转换业务的办理场所及本基金与其他基金转换的相关内容。
6、"十、基金的投资"部分，更新了截至2014年9月30日的基金的投资组合报告。
7、"十一、基金的业绩"部分，更新了截至2014 年9月30日的基金业绩数据。
8、"十九、基金合同的变更、终止与基金财产清算"部分，根据法规修改了基金合同变更的条款。
9、"二十二、对基金份额持有人的服务"中更新了"（一）资料寄送"中的相关内容与"（三）定期定额投资计划"中的相关内容。
10、"二十三、其他应披露事项"部分，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《招募说明书》后面所载之详细资料一并阅读。

华宝兴业基金管理有限公司
2014年12月10日

华宝兴业基金管理有限公司关于旗下基金持有的"迪安诊断"、"卫宁软件"估值方法调整的公告

鉴于"迪安诊断（股票代码：300244）"、"卫宁软件（股票代码：300253）"股票因重大事项停牌，根据中国证券监督管理委员会[2008]38号公告《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的有关规定，华宝兴业基金管理有限公司（以下简称"本公司"）为确保本公司持有该股票的基金估值更加公平、合理，经与相关基金托管银行、会计师事务所协商一致，自2014年12月9日起，对公司旗下基金持有的"迪安诊断"、"卫宁软件"股票采用"指数收益法"予以估值。

停牌期间，本公司将与上市公司保持密切沟通，切实保护基金份额持有人利益。待上述股票复牌且其交易体现了活跃市场交易特征后，将恢复为采用当日收盘价格进行估值，届时不再另行公告。

特此公告。

华宝兴业基金管理有限公司
2014年12月10日