华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金招募说明书

【重要提示】

本基金根据中国证券监督管理委员会2010年11月24日证监许可【2010】1694号文核准募集。

基金管理人保证《华宝兴业成熟市场动量优选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，本基金的特定风险，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》。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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

投资有风险，投资人认购(或申购)本基金时应认真阅读本招募说明书。

一、绪 言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》(以下简称“《试行办法》”)，其他有关规定及《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)编写。

本招募说明书阐述了华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的必要事项，投资人在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金是根据本招募说明书所载明资料申请募集的。本招募说明书由本基金管理人解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作出任何解释或者说明。

本招募说明书根据基金合同编写，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。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，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》、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。

二、释 义

在本招募说明书中，除非文义另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金

2、基金管理人：指华宝兴业基金管理有限公司

3、基金托管人：指中国银行股份有限公司

4、境外投资顾问：指Lyxor Asset Management S.A.(领先资产管理公司)

5、境外基金托管人：指中国银行(香港)有限公司

6、基金合同：指《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

7、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

8、招募说明书或本招募说明书：指《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

9、基金份额发售公告：指《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金份额发售公告》

10、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

11、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订

12、《试行办法》：指中国证监会2007年6月21日颁布、同年7月5日实施的《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、外管局：指国家外汇管理局或其授权的代表机构

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和或中国银行业监督管理委员会

16、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

17、个人投资者：指年满18周岁，合法持有现时有效的中华人民共和国居民身份证、军人证件等有效身份证件的中国公民，以及中国证监会批准的其他可以投资基金的自然人

18、机构投资者：指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

19、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内合法设立的证券投资基金的中国境外的机构投资者

19、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

20、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

21、基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金、发售基金份额、办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

22、销售机构：指直销机构和代销机构

23、直销机构：指华宝兴业基金管理有限公司

24、代销机构：指与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

25、基金销售网点：指直销机构的直销柜台及代销机构的代销网点

26、基金网上交易系统：指直销机构的直销e网金及代销机构的网上交易系统

27、登记结算业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等

28、登记结算机构：指办理登记结算业务的机构。基金的登记结算机构为华宝兴业基金管理有限公司或接受华宝兴业基金管理有限公司委托代为办理登记结算业务的机构

29、基金账户：指登记结算机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

30、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户

31、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

32、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

33、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

34、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

35、工作日：上海证券交易所、深圳证券交易所以及纽约、伦敦、东京、法兰克福、香港、悉尼证券交易所同时正常交易的交易日(但是，本合同涉及信息披露和备案等类似条款所指的工作日，是指除中国法定节假日之外的日期)；

36、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

37、T日：指销售机构在规定的开放时间受理投资者申购、赎回或其他业务有效申请的工作日

38、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

39、D日：本基金暂停申购或赎回后重新开放该业务的开放日

40、交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

41、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为

42、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

43、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

44、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

45、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请(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)超过上一开放日基金总份额的10%

46、元：指人民币元

47、基金收益：指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额

48、基金已实现收益：指基金利润减去公允价值变动收益后的余额

49、基金可供分配利润：指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数

50、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

51、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

52、基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一登记结算机构办理登记结算的其他基金基金份额的行为

53、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

54、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

55、不可抗力：指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

三、风险揭示

(一)投资于本基金的风险

本基金特有风险：

1、金融模型风险：模型风险指由于市场环境的变化、模型使用不当等，导致金融模型在某些情况下可能出现有效性降低甚至无效的状况。对于本基金来说，出现这种情况的原因主要包括以下几个方面：

①历史数据的使用：资产的波动率及各类资产的相关性数据主要通过历史数据取得，当特定资产的基本面发生重大变化时，资产波动率及相关性数据可能与现实出现一定程度的偏差进而影响模型结果的精确性和有效性。

②模型参数估计错误：本基金模型中的部分参数需要基金管理人根据主观判断进行估计，在这种情况下可能出现基金管理人参数估计错误，从而导致模型有效性降低甚至失效的情况。

③模型操作不当：可能存在基金管理人使用模型时数据录入出错，模型运用不当等操作型风险，进而影响模型的有效性。

2、动量策略的风险：本基金采用以动量策略为主的多因素量化投资模型来进行基金资产在不同类别以及地区之间的配置。动量策略在市场出现快速上涨或下跌的过程中可能存在一定的反应时滞，影响策略的有效性。同时，在市场出现频繁的波动时，动量策略的有效性可能受到较大影响。

另外，本基金采用合成期权的方法来捕捉市场动量，因此运作过程中可能存在实际组合与合成期权的之间有对冲误差的风险，这种误差的大小将主要由相关资产的波动率以及合成期权的Gamma值决定。

3、基金中基金的风险：对于基金中基金而言，还存在着标的基金基金管理人自身经营管理不善，而出现标的基金的投资以及运作等风险，严重时甚至导致标的基金的清盘，进而影响本基金的整体收益。

4、集中度风险

本基金为全球资产配置型基金，在部分市场条件下可能出现基金资产相对集中在股票类资产或债券类资产上的情况。此时基金资产对这类资产的风险暴露度会显著增加，出现集中度风险。

QDII基的共同风险：

5、海外市场风险：由于本基金投资于海外证券市场，因此各国或地区处于不同产业景气循环周期，也将对基金的投资绩效产生影响。海外证券市场可能由于对于负面的特定事件，该国或地区特有的政治因素、法律法规、市场状况、经济发展趋势的反映较境内证券市场有诸多不同。并且，这些国家或地区证券的每日涨跌幅空间相对较大。以上所述因素可能会带来市场的急剧下跌，从而带来投资风险的增加。

6、政府管制风险：因财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等宏观政策发生变化，导致市场波动而影响基金收益，产生风险。

7、政治风险：政治风险指因所投资地政治不稳定而蒙受损失的风险，这可以是由政权更迭、政策及法规的改变所造成。

8、流动性风险：本基金面临的证券市场流动性风险主要表现在几个方面：基金资产不能迅速转变成现金，或变现成本很高；不能应付可能出现的投资人大额赎回的风险；证券投资中个券的流动性风险等。这些风险的主要形成原因是：

①市场整体流动性相对不足。证券市场的流动性受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响，在某些时期成交活跃，流动性非常好，而在另一些时期，则可能成交稀少，流动性差。在市场流动性相对不足时，交易变现都有可能因流动性问题而增加变现成本，对本基金的资产净值造成不利影响。这种风险在发生大额赎回时表现尤为突出。

②证券市场中流动性不均匀，存在个券流动性风险。由于流动性存在差异，即使在市场流动性比较好的情况下，一些个券的流动性可能仍然比较差，这种情况的存在使得本基金在进行个券操作时，可能难以按计划买入或卖出相应的数量，或买入卖出行为对个券价格产生比较大的影响，增加个券的建仓成本或变现成本。这种风险在出现个券停牌和涨跌停板等情况时表现得尤为突出。

另外，本基金投资于海外，这就使得投资人的资金调度较为不便。基金的赎回净值是以赎回申请日为准，但真正赎回时的转换汇率却是以汇入投资人帐户当日为准。由于期间差异为7-14天，因此对赎回的投资人而言，不到最后资金汇入其帐户，很难确知具体的金额，增加了投资人理财规划的不便。

9、汇率风险：本基金以人民币为计价单位，但所投资的资产及来自该等资产的收入将会或可能会以其他货币为单位，因此本基金的资产会受持有资产的货币与人民币之间的汇率走势所影响。本基金的投资表现也可能受外汇管制规定变更的影响。

10、操作风险：指在本基金在交易和结算中，由于内部控制系统不完善或缺乏必要的后台技术支持而导致的风险。具体包括两类：一是由于内部监管体系不完善、经营管理上出现漏洞、工作流程不合理等带来的风险；二是由于各种偶发性事故或自然灾害，如电脑系统故障、通讯系统瘫痪、地震、火灾、工作人员差错等给基金交易者造成损失的可能性。决定营运风险的形成及大小的主要因素包括管理漏洞和内部控制失当、交易员操作不当以及会计处理偏差等。

11、会计核算风险：会计核算风险主要是指由于会计核算及会计管理上违规操作形成的风险，通常是指基金会计在计算、整理、制证、填单、登账、编表、保管及其相关业务处理中，由于客观原因与非主观故意所造成的行为过失。

12、交易结算风险：结算风险是一种特殊形式的信用风险。当双方在同一天进行交换时，就会产生结算风险。在一方已经进行了支付后，如果另一方发生违约，就会产生结算风险。

13、法律风险：指由于本基金交易合约的条款在法律上有缺陷或缺失法律的支持等原因可能导致的风险。

14、信用风险：信用风险是指债券发行人是否能够实现发行时的承诺，按时足额还本付息的风险。一般认为：国债的信用风险可以视为零，而其它债券的信用风险可按专业机构的信用评级确定，信用等级的变化或市场对某一信用等级水平下债券率的变化都会迅速的改变债券的价格，从而影响到基金资产。

15、利率风险：利率风险是指由于利率变动而导致的证券价格和证券利息的损失。利率风险是债券投资所面临的主要风险，息票利率、期限和到期收益率水平都将影响债券的利率风险水平。利率的波动仅间接影响到股市。

16、大宗交易风险：大宗交易的成交价格并非完全由市场供需关系形成，可能与市场价格存在一定差异，从而导致大宗交易参与者的非正常损益。

17、管理风险

在基金管理运作过程中，如果基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人对经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不全、投资操作出现失误，都会影响基金的收益水平。

18、其他风险

①因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；

②因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

③因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

④对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

⑤因业务竞争压力可能产生的风险。

(二)声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资人自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过代销机构代理销售，但是，基金并不是代销机构的存款或负债，也没有经代销机构担保或者背书，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

四、基金的投资

(一)投资目标

本基金通过投资于发达市场交易型开放式基金(ETF)等金融工具，在国际范围内分散投资风险，追求基金资产长期增值。

(二)基准货币

本基金的基准货币是人民币。

(三)投资范围

本本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的交易型开放式基金(ETF)、债券、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。其中，ETF的标的市场是美洲、欧洲、及亚太地区的发达国家和地区。具体为澳大利亚、奥地利、比利时、加拿大、丹麦、芬兰、法国、德国、希腊、香港特别行政区、爱尔兰、意大利、日本、荷兰、新西兰、挪威、葡萄牙、新加坡、西班牙、瑞典、瑞士、英国和美国。

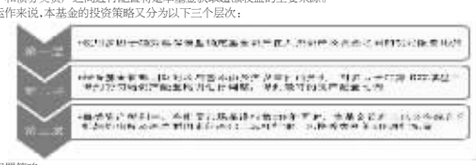
本基金各类资产配置的比例范围为：ETF占基金资产的比例为60%-95%，债券、现金及中国证监会允许的其它投资品种的比例为基金资产的5%-40%(现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%)。

如与中国证监会签订双边监管合作谅解备忘录的国家或地区增加、减少或变更，根据有关法律法规，本基金投资的证券市场范围将作相应调整。如果业绩比较基准中成熟市场的覆盖发生变动，本基金投资的证券市场范围亦将作相应调整。在有关法律法规发生变动时，本基金资产配置比例等应作相应调整。

(四)投资策略

本基金的投资策略主要分为资产配置策略和单个金融产品选择策略两个部分，其中，将基金资产在全球成熟金融市场的股票类资产和债券类资产之间进行配置将是本基金获取超额收益的主要来源。

从具体运作来说，本基金的投资策略又分为以下三个层次：



1、资产配置策略

资产配置是本基金投资的重点环节，本基金会在留出足够现金头寸应对基金的短期申购赎回的前提下，重点将基金资产在以下八大类别资产之间进行动态配置，分别是：美国股票、日本股票、欧洲成熟市场股票、亚太成熟市场股票(除日本外)、美国债券、欧洲债券、美国通胀关联债券和欧洲通胀关联债券。

本基金的初步资产配置将在运用本基金管理人与境外投资顾问共同开发的多因子趋势追踪系统分析的基础上，结合本基金投研团队对相关资产类别未来趋势的判断确定。具体流程如下：

①多因子趋势追踪模型介绍

本基金管理人与境外投资顾问共同开发的多因子趋势追踪系统是本基金整体投资策略的重要组成部分。该系统通过对相关资产类别的动量因子，基本面因子的量化分析，来确定一定时期较为强势的资产类别，综合风险和相关性的分析，确定各个资产类别的初始配置权重，把握上涨趋势，避开资产的下跌趋势，并得到该类资产的预期收益率。

2)组合收益风险优化过程

在第一步分析的基础上，本基金将使用基于均值/方差方法的组合优化模型确定相关资产类别的初始配置权重。

通过前面的分析，本基金管理人形成对相关资产类别预期收益率的判断，再结合通过历史波动率及相关衍生品隐含波动率的分析形成本基金预期波动率的判断，以及不同资产类别之间相关性的判断等，在风险控制指标的约束下，运用马克维茨均值/方差的分析方法确定相关资产类别的初始配置比例。

3)基本面因子分析

在以上分析的基础上，本基金会进一步借助境外投资顾问的宏观量化分析体系，综合考虑相关市场宏观经济，资本市场及经济政策等因子，根据当期特定市场环境，以及不同资产类别的特点，采用数量化的方法，对优化过程形成的初始配置权重进行调整。

本基金所涉及的部分基本面因子如下表所示：

宏观经济	资本市场
工业增加值；信心指数；	全市场ROE、EV&EBITDA；
生产/消费物价指数；	利润率；
市场利率；大宗商品价格等	估值指标；股息率等

②基金管理人的分析与判断

(下转D10版)

华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金份额发售公告

重要提示

1、华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金的募集已获中国证券监督管理委员会2010年11月24日证监许可【2010】1694号文核准。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做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

2、华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金是契约型开放式基金。

3、华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金(以下简称“本基金”)将自2011年2月21日起至2011年3月11日，通过华宝兴业基金管理有限公司(以下简称“本公司”)的直销柜台和直销e网金、中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)、中国民生银行股份有限公司(以下简称“民生银行”)、交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)、上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“浦发银行”)、华泰联合证券有限责任公司(以下简称“华泰联合证券”)、国泰君安证券股份有限公司(以下简称“国泰君安证券”)、海通证券股份有限公司(以下简称“海通证券”)、广发证券股份有限公司(以下“广发证券”)、广发华福证券有限责任公司(以下简称“广发华福证券”)、光大证券股份有限公司(以下简称“光大证券”)、东方证券股份有限公司(以下简称“东方证券”)、平安证券有限责任公司(以下简称“平安证券”)、渤海证券股份有限公司(以下简称“渤海证券”)、安信证券股份有限公司(以下简称“安信证券”)、国信证券股份有限公司(以下简称“国信证券”)、国元证券股份有限公司(以下简称“国元证券”)、长城证券有限责任公司(以下简称“长城证券”)、兴业证券股份有限公司(以下简称“兴业证券”)、东吴证券股份有限公司(以下简称“东吴证券”)、中信万通证券有限责任公司(以下简称“中信万通证券”)、中银国际证券有限责任公司(以下简称“中银国际证券”)、方正证券有限责任公司(以下简称“方正证券”)、华宝证券有限责任公司(以下简称“华宝证券”)、齐鲁证券有限公司(以下简称“齐鲁证券”)、上海证券有限责任公司(以下简称“上海证券”)、信达证券股份有限公司(以下简称“信达证券”)、江海证券有限公司(以下简称“江海证券”)、国都证券有限责任公司(以下简称“国都证券”)、德邦证券有限责任公司(以下简称“德邦证券”)、东海证券有限责任公司(以下简称“东海证券”)、华安证券有限责任公司(以下简称“华安证券”)、中信建投证券有限责任公司(以下简称“中信建投证券”)、长江证券股份有限公司(以下简称“长江证券”)、中国建银投资证券有限责任公司(以下简称“中投证券”)、中银万国证券股份有限公司(以下简称“中银万国”)的网点和网上交易系统销售。

4、持有工商银行卡、建设银行卡、农业银行卡、广发银行卡、招商银行卡、民生银行卡、兴业银行卡、天天盈账户的个人投资者在与本公司达成网上交易的相关协议，按受本公司有关服务条款并办理相关手续后，即可登录本公司网站(www.fsfund.com)，办理基金账户开立、认购、资料变更、分红方式变更、信息查询等各项业务。

5、本基金募集对象为个人投资者、机构投资者和合格的境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。个人投资者指年满18周岁，合法持有现时有效的中华人民共和国居民身份证、军人证件等有效身份证件的中国公民，以及符合法律法规规定的条件或中国证监会批准的其他可以投资开放式证券投资基金的自然人；机构投资者指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织。合格境外机构投资者指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内证券市场的中国境外的机构投资者。

6、本基金设定募集目标上限为40亿元人民币。本基金募集期内正常认购日日间不停止销售，但如当日认购结束后发现累计认购申请接近或超过募集上限，基金管理人将于次日在指定媒体上公告本基金于公告当日停止销售。若募集期内认购申请全部确认后本基金的总金额不超过40亿元人民币(含)，则所有的有效认购申请全部予以确认。若募集期内认购申请全部确认后本基金的总金额超过40亿元人民币，则对募集期内的有效认购申请采用“比例确认”的原则给予部分确认，未确认部分的认购款项退还给投资者。

7、投资人欲购买本基金，需开立本公司基金账户。基金募集期内本公司直销柜台、直销e网金和指定代销网点同时为投资人办理开立基金账户的手续。在基金募集期间，投资人的开户和认购申请可同时办理。

8、根据中国证监会的规定，一个投资人只能开设和使用一个基金账户；不得非法利用他人账户或资金进行认购，也不得违规融资或帮助他人违规进行认购。

投资者应保证用于认购的资金来源合法，投资者应有权自行支配，不存在任何法律上、合约上或其他障碍。

9、本基金的认购金额：通过代销机构网点、代销机构网上交易系统和直销e网金认购本基金份额单笔最低金额为5,000元人民币。通过直销柜台首次认购的最低金额为10万元人民币，追加认购最低金额为1,000元人民币。投资人在募集期内可多次认购基金份额，但认购申请一经销售机构受理，则不可以撤销。

10、销售网点：指代销网点和或直销网点)对申请的受理并不表示对该申请的成功确认，而仅代表销售网点确实接受了认购申请，申请的成功确认应以基金注册登记机构(本基金的注册登记机构由本公司担任)的确认登记为准。投资人可以在基金合同生效后到原认购网点打印认购成交确认凭证。

11、本公告仅对本基金募集的有关事项和规定予以说明。投资人欲了解本基金的详细情况，请详细阅读刊登在201X年X月X日的《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》上的《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)。

12、本基金的基金合同、招募说明书及本公告将同时发布在本公司网站和本基金代销机构网站。投资人亦可通过本公司网站下载基金申请表格和了解基金募集相关事宜。

13、各代销机构的办理网点、办理日期和时间等事项参照各代销机构在其各销售城市当地的公告。

14、在募集期间，除本公告所列的代销机构外，如增加其他代销机构将及时公告。

15、本公司可根据基金销售情况适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。

16、基金管理人可综合各种情况对募集安排做适当调整。

17、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，本基金的特定风险等等。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》。

一、本次基金份额发售基本情况

1、基金名称：华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金

2、基金类型：契约型开放式

3、基金存续期限：不定期

4、基金份额初始面值：1.00元人民币

5、募集目标：本基金募集规模上限为40亿元人民币。

6、募集对象：个人投资者、机构投资者和合格的境外机构投资者

7、销售渠道与销售地点

(1)直销机构

1)直销柜台

本公司在上海开设直销柜台。

地址：上海市世纪大道88号金茂大厦48层

邮政编码：200121

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

直销柜台传真：021-50499663、50499667、50988055

募集期间，客户可以通过本公司客户服务中心电话进行募集相关事宜的问询、开放式基金的投资咨询及投诉等。直销客户还可以通过本公司客户服务中心电话查询汇入资金的到账情况。

2)直销e网金

投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购等业务，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

中国银行、交通银行、浦发银行、民生银行、上海证券、国都证券、信达证券、江海证券、东吴证券、德邦证券、国泰君安证券、东方证券、广发华福证券、中信万通证券、方正证券、中银国际证券、华宝证券、平安证券、齐鲁证券、华泰联合证券、光大证券、国信证券、长城证券、兴业证券、海通证券、国元证券、广发证券、渤海证券、东海证券、安信证券、华安证券、中信建投证券、长江证券、中投证券、中银万国办理基金的网点业务。

(3)承担受信责任，在挑选、委托投资顾问过程中，履行尽职调查义务，对其委托的境外投资顾问及其他第三方机构的相关事项的法律后果承担责任。

(4)法律法规、中国证监会和外管局根据审慎监管原则规定的其他职责以及基金合同规定的其他义务。

(二)基金托管人

1、基金托管人基本情况

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

成立日期：1983年10月31日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

存续期间：持续经营

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代营外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贸金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

2、基金托管人的权利

①依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

②依照基金合同的约定获得基金托管费；

③监督基金管理人对本基金的投资运作；

④在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；

⑤依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；

⑥选择、更换境外托管人并与之签署有关协议；

⑦法律法规、基金合同规定的其它权利。

3、基金托管人的义务

①安全保管基金财产，准时将公司行为信息通知基金管理人，确保基金及时收取所有应得收入；

②设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产境内托管事宜；

③按规定开设基金财产的资金帐户和证券帐户；

④除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益；

⑤对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立；

⑥按照有关法律法规和基金合同的规定以受托人名义或其指定的代理人名义登记资产；

⑦每月结束后7个工作日内，向中国证监会和外管局报告基金境外投资情况，并按相关规定进行国际收支申报；

⑧妥善保存有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务；

⑨选择符合《试行办法》第十九条规定的境外托管人。对基金的境外财产，可授权境外托管人代为履行其承担的受托人职责。境外托管人在履行职责过程中，因本身过错、疏忽等原因而导致基金财产受损的，托管人应当承担相应责任；

⑩保管《委托境外托管人》由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

⑪保存基金托管业务活动的记录、帐簿、报表和其他相关资料；

⑫按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

⑬保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；

⑭办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

⑮对基金财务会计报告、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

⑯保存基金份额持有人名册；

⑰复核基金管理人计算的基金财产净值、基金份额净值和基金份额申购、赎回价格；

⑱按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

⑲依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

⑳按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

㉑按照规定监督基金管理人的投资运作；

㉒因过错违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；除法律法规另有规定外，基金托管人不承担连带责任；

㉓基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

㉔对其委托第三方机构相关事项的法律后果承担责任；

㉕法律法规、中国证监会和外管局规定的其他职责以及基金合同规定的其他义务。

(三)基金份额持有人

1、基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

2、基金份额持有人的权利

①分享基金财产收益；

②参与分配清算后的剩余基金财产；

③依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

④按照规定要求召开基金份额持有人大会；

⑤出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

⑥查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

⑦监督基金管理人的投资运作；

⑧对基金管理人、基金托管人、损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

⑨法律法规、基金合同规定的其它权利。

3、基金份额持有人的义务

①遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；

②缴纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同规定的费用；

③在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

④不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法利益的活动；

⑤执行基金份额持有人大会的决议；

⑥返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人、各自委托的第三方机构及其他基金份额持有人处获得的不当得利；

⑦基金份额持有人应遵守基金管理人、基金托管人、代理销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则；

⑧法律法规及基金合同规定的其他义务。

二、基金份额持有人大会

(一)本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人和/或其合法授权代表组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

(二)有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

1、终止基金合同，但基金合同另有约定的除外；

2、转换基金运作方式；

3、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

4、更换基金管理人、基金托管人；

5、变更基金类别；

6、变更基金投资目标、范围或策略；

7、变更基金份额持有人大会程序；

8、本基金与其它基金合并；

9、对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

10、法律法规或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。

(三)以下情况不需召开基金份额持有人大会，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同：

1、调低基金管理费、基金托管费；

2、在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率或收费方式、调低赎回费率；

3、因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

4、对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

5、对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

6、经中国证监会允许，基金管理人、注册登记机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

7、在不违反法律法规规定的情况下，接受其它币种的申购、赎回；

8、除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其它情形。

(四)召集方式：

1、除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。@ 基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

3、代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人