# 华宝先进成长混合型证券投资基金招募说明书摘要(更新)

2018年第1号

## 基金管理人:华宝基金管理有限公司
## 基金托管人:中国银行股份有限公司

【重要提示】

本基金根据中国证券监督管理委员会《关于同意华宝先进成长混合型证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2006]200号)的核准,进行募集。基金合同于2006年11月7日正式生效。

基金管理人保证《华宝先进成长混合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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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

投资有风险,投资人申购本基金时应认真阅读本基金招募说明书。

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》。

本招募说明书摘要所载内容截止日为2018年5月7日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年3月31日,数据未经审计。

**一、《基金合同》生效日期**

本基金自2006年10月12日到2006年11月3日向个人投资者和机构投资者同时发售,《基金合同》于2006年11月7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、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。

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市场总监兼战略策划部总经理。

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、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

曾豪,曾任中信证券股份有限公司担任执行总监兼首席分析师的职务。2015年6月加入华宝基金管理有限公司,担任研究部总经理的职务。2017年12月起任华宝先进成长混合型证券投资基金基金经理。

5、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、华宝高端制造股票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、华宝智慧产业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、华宝品质生活股票型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。

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、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。

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:中国银行股份有限公司(简称"中国银行")

住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期:1983年10月31日

注册资本:人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人:陈四清

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人:王永民

传真:(010)66594942

中国银行客服电话:95566

(二)基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具有海外工作、学习或培训经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。

(三)证券投资基金托管情况

截至2018年3月31日,中国银行已托管660只证券投资基金,其中境内基金623只,QDII基金37只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

(四)托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分,秉承中国银行风险控制理念,坚持"规范运作、稳健经营"的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节,通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起,中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于"SAS70"、"AAF01/06"、"ISAE3402"和"SSAE16"等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年,中国银行继续获得了基于"ISAE3402"和"SSAE16"双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善,内控措施严密,能够有效保证托管资产的安全。

(五)托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。

**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

注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人:姜建清

联系电话:95588

客户电话:95588

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

法定代表人:蒋超良

联系电话:95599

客户电话:95599

公司网址: www.95599.cn

(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

法定代表人:田国立

联系电话:95566

客户电话: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

法定代表人:王洪章

客户电话:95533

公司网址:www.ccb.com

(5)交通银行股份有限公司

办公地址:上海市银城中路188号

注册地址:上海市银城中路188号

法定代表人:牛锡明

联系人:曹榕

联系电话:(021)58781234

传真:(021)58408483

客户电话: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

法定代表人:李建红

联系人:邓炯鹏

联系电话:0755-83198888

客户电话:95555

公司网址:www.cmbchina.com

(7)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

联系电话:95561或拨打各城市营业网点咨询电话

客户电话:95561 或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址:http://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

法定代表人:洪崎

联系人:王志刚

联系电话:010-58560666

传真:010-57092611

客户电话: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

法定代表人:李伏安

联系人:王星

联系电话:400-888-8811

客户电话:95541

公司网址:www.cbhb.com.cn

(10)广发银行股份有限公司

办公地址:广东省广州市农林下路 83 号

注册地址:广东省广州市农林下路 83 号

法定代表人:李若虹

客户电话:800-830-8003;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

法定代表人:吴建

联系电话:95577

客户电话:95577

公司网址:www.hxb.com.cn

(12)江苏银行股份有限公司

办公地址:南京市洪武北路55号

法定代表人:黄志伟

客户电话: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:深圳市深南东路5047号

法定代表人:孙建一

联系人:戴青

客户电话:95511-3

公司网址:bank.pingan.com

(14)上海浦东发展银行股份有限公司

办公地址:中国·上海市中山东一路12号

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:周志杰

联系电话:021-61618888

传真:021-63604196

客户电话: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

法定代表人:李庆萍

联系人:王晓琳

客户电话:95558

公司网址:bank.ecitic.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楼

法定代表人:王连志

联系人:杨天枝

联系电话:0755-82558323

传真:0755-82558355

客户电话:4008-001-001

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号渤海证券

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:王春峰

联系人:王星

联系电话:022-28451922

传真:022-28451958

客户电话:4006515988

公司网址:http://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14、16、17层

法定代表人:丁益

联系人:金夏

联系电话:021-62821733

客户电话:0755-33680000,400 6666 888

公司网址:www.cgws.com

(19)长江证券股份有限公司

办公地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人:崔少华

联系人:奚博宇

联系电话:027-65799999

传真:027-85481900

客户电话:95579或4008-888-999

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:姚文平

联系人:刘熠

联系电话:021-68761616-8507

传真:021-68767981

客户电话: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

法定代表人:李福春

联系人:安岩岩

联系电话:0431-85096517

传真:0431-85096795

客户电话: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

法定代表人:潘鑫军

联系人:黄静

联系电话:021-63325888

传真:021-63326729

客户电话: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

联系电话:021-20333910

传真:021-50498825

客户电话: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:苏州工业园区星阳街5号东吴证券大厦

法定代表人:范力

联系人:郭晶晶

联系电话:0512-62938521

传真:0512-62938527

客户电话: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:010-66555316

传真:010-66555246

客户电话: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:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

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

联系电话:95571

客户电话: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:薛峰

联系人:姚巍

联系电话:021-22169999

传真:021-22169134

客户电话:95525

公司网址:www.ebscn.com

(28)广发证券股份有限公司

办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼

注册地址: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:黄岚

联系电话:95575

客户电话:95575或致电各地营业网点

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南大街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

法定代表人:王少华

联系人:李弢

联系电话:400-818-8118

客户电话:400-818-8118

公司网址:www.guodu.com

(30)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:丁学东

联系人:吕卓

联系电话:010-65051166

传真:010-65058065

客户电话:400-910-1166

公司网址:www.cicc.com

(31)国泰君安证券股份有限公司

办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

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

联系电话:021-38032284

传真:021-38670666

客户电话:95521

公司网址:www.gtja.com

(32)国信证券股份有限公司

办公地址:深圳市红岭中路1012号国信证券大厦

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

联系电话:0755-82130833

传真:0755-82133952

客户电话:95536

公司网址:www.guosen.com.cn

(33)国元证券股份有限公司

注册地址:合肥寿春路179号

法定代表人:凤良志

联系电话:95578

客户电话:4008888777或95578

公司网址:www.gyzq.com.cn

(34)海通证券股份有限公司

办公地址:上海广东路689号

注册地址:上海淮海中路98号

法定代表人:周杰

联系人:李楠

联系电话:021-23219000

客户电话:95553、400-8888-001或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址:www.htsec.com

(35)恒泰证券股份有限公司

办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号

注册地址: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

客户电话:400-196-6188

公司网址:www.cnht.com.cn

(36)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

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

联系电话:0991-2307105

传真:0991-2301927

客户电话:400-800-0562

公司网址:www.hysec.com

(37)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号财智中心B1座0327室

注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

法定代表人:章宏韬

联系电话:0551-65161666

传真:0551-65161600

客户电话:95318

公司网址:www.hazq.com

(38)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

联系电话:021-68777222

传真:021-68777822

客户电话:400-820-9898、021-38929908

公司网址:www.cnhbstock.com

(39)华福证券有限责任公司

办公地址:福州市五四路157 号新天地大厦7、8 层

法定代表人:黄金琳

客户电话:96326(福建省外请加拨0591)

公司网址:www.hfzq.com.cn

(40)华泰证券股份有限公司

办公地址:南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场

注册地址:南京市江东中路228号

法定代表人:周易

联系人:马艺卿

联系电话:025-83389093

客户电话:95597

公司网址:www.htsc.com.cn

(41)江海证券有限公司

办公地址:黑龙江省哈尔滨市松北区创新三路833号

注册地址: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:姜志伟

传真:0451-82337279

客户电话:0451-82337279

公司网址:www.jhzq.com.cn

(42)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16-20层

法定代表人:余政

联系人:韩秀萍

联系电话:010-85127609

传真:010-85127917

客户电话:400-619-8888

公司网址:www.mszq.com

(43)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:何亚刚

客户电话:4008895618

公司网址:www.e5618.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

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:刘世安

联系人:周驰

传真:0755-82435367

客户电话:95511-8

公司网址:www.stock.pingan.com

(45)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:0351-8686659

传真:0351-8686619

客户电话:400-666-1618、95573

公司网址:www.i618.com.cn

(46)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:021-53686888

传真:021-53686100、021-53686200

客户电话:021-962518

公司网址:www.962518.com

(47)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45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:黄莹

联系电话:021-33388211

传真:021-33388224

客户电话:95523、4008895523

公司网址: www.swhysc.com

(48)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

法定代表人:张志刚

联系人:付婷

联系电话:010-63081493

传真:010-63081344

客户电话:95321

公司网址:www.cindasc.com

(49)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:杨华辉

客户电话:95562

公司网址:www.xyzq.com.cn

(50)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

法定代表人:陈有安

联系人:辛国政

联系电话:010-66568292

客户电话:95551、400-8888-888

公司网址:www.chinastock.com.cn

(51)招商证券股份有限公司

办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座39-45层

注册地址: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

联系人:黄婵君

联系电话:0755-82943666

传真:0755-82943227

客户电话:4008895565或95565

公司网址:www.newone.com.cn

(52)中航证券有限公司

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

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

法定代表人:王宜四

联系人:孙超

联系电话:0791-86768681

传真:0791-86789414

客户电话:400-8866-567

公司网址:www.avicsec.com

(53)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:许曼华

联系电话:021-20315290

传真:021-20315125

客户电话:95538

公司网址:www.zts.com.cn

(54)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:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A座第04层、18-21层

法定代表人:高涛

联系电话:0755-82023442

传真:0755-82026539

客户电话:95532或400 600 8008

公司网址:www.china-invs.cn

(55)中信建投证券股份有限公司

办公地址:北京市朝阳门内大街188号

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

客户电话:400-8888-108、95587

公司网址:www.csc108.com

(56)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:0755-23953913

传真:0755-83217421

客户电话:400-990-8826

公司网址:www.citicsf.com

(57)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:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人:张佑君

联系人:王一通

联系电话:010-60838888

传真:010-60833739

客户电话:95548

公司网址:www.cs.ecitic.com

(58)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

法定代表人:姜晓林

联系人:刘晓明

联系电话:0531-89606165

传真:0532-85022605

客户电话:95548

公司网址:www.zxwt.com.cn

(59)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:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层

法定代表人:宁敏

联系人:李鹏

联系电话:400-620-8888

传真:021-50372474

客户电话:4006208888或各地营业网点咨询电话

公司网址:www.bocichina.com

(60)华宝直销

(61)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

客户电话:400-700-9665

公司网址:www.ehowbuy.com

(62)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

客户电话:400-920-0022

公司网址:www.licaike.com

(63)上海华夏财富投资管理有限公司

客户电话:400-817-5666

(64)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

客户电话:400-166-1188

公司网址:http://8.jrj.com.cn

(65)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

客户电话:4000988511

公司网址:http://kenterui.jd.com

(66)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

客户电话:4000-466-788

公司网址:www.66zichan.com

(67)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

客户电话:4008219031

公司网址:www.lufunds.com

(68)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

客户电话:400-821-5399

公司网址:www.noah-fund.com

(69)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

客户电话:4000-776-123

客户电话:4000-776-123

公司网址:http://www.fund123.cn/

(70)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

客户电话:95177

公司网址:www.snjijin.com

(71)深圳腾元基金销售有限公司

办公地址:深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806-1810

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

法定代表人:曾革

联系人:杨苗苗

联系电话:0755-33376922

客户电话:4006-877-899

公司网址:www.tenyuanfund.com

(72)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

客户电话:400-1818-188

公司网址:www.1234567.com.cn

(73)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

客户电话:4008-773-772

公司网址:www.5ifund.com

(74)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

客户电话:021-50810673

公司网址:www.wacaijijin.com

(75)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

客户电话:400-821-0203

(76)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

客户电话:010-62675369

公司网址:www.xincai.com

(77)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

客户电话:400-6099-200

公司网址:www.yixinfund.com

(78)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

客户电话:400-684-0500

公司网址:www.ifastps.com.cn

(79)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

客户电话:400-600-0030

公司网址:www.bzfunds.com

(80)深圳众禄基金销售股份有限公司

办公地址:深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼

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

客户电话:400-678-8887

公司网址:www.zlfund.cn

(81)珠海盈米财富管理有限公司

办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203

客户电话:020-89629099

公司网址:www.yingmi.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:曹阳

经办注册会计师:薛竞、曹阳

**五、基金简介**

基金名称:华宝先进成长混合型证券投资基金

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、理念、范围、策略、业绩比较基准和风险收益特征

1.投资目标

分享我国经济增长方式转变过程中和转变完成后的先进企业的成长,在控制风险的前提下为基金份额持有人谋求长期超额的回报。

2.投资理念

先进引领成长,创造超额回报。

3.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,包括国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。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。

4.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,通过公司自行开发的数量化辅助模型,结合宏观策略研究,对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪,决定大类资产配置比例。本基金股票投资比例为60%-95%,其中投资于先进企业的股票占非现金资产的比例不低于80%,权证投资比例为0%-3%,债券及现金投资比例为5%-40%(其中,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券不低于5%)。"先进企业"是指具备创新能力强、注重资源节约与环境友好、充分发挥人力资源优势这三个先进因素之一的企业。

(2)股票投资策略

本基金认为,公司未来盈利的增长是股价上涨的主要驱动因素,在中国经济长期高速增长的背景下,创新能力强、注重资源节约与环境友好、充分发挥人力资源优势的先进企业具有更大的发展空间,投资于先进企业可以获取长期超额回报。因此将对上市公司基本面的深入研究和长期前景的关注作为基金的投资基础。

1)本基金首先将在公司三级股票库的基础上选用7个定量指标来筛选出排名靠前、成长潜力较大的上市公司作为本基金的备选库。这7个定量指标分别为:

a. 成长指标:过去三年平均主营业务收入增长率、过去三年平均息税折旧前利润(EBITA)增长率、未来一年预测每股收益(EPS)增长率、未来第二年预测每股收益(EPS)增长率;

b. 价值指标:预测动态市盈率;

c. 盈利指标:过去三年平均净资产收益率(ROE)、过去三年平均投资回报率(ROIC)。

2)然后,本基金将对有成长潜力的上市公司进行进一步案头研究和实地调研,深入研究企业的基本面,精选符合本基金先进性判断的上市公司。

a. 企业先进性判断

创新能力:重点关注具有先进的设备和技术、较好的品牌、创新的盈利模式和管理制度的企业。具体的指标包括研发(R&D)经费支出、研发(R&D)经费投入强度、专利申请数、发明专利量比重、新产品产值率、信息化程度等;

资源节约和环境保护能力:重点关注资源节约和环境友好的企业、开发生产新能源新材料的企业、开发生产资源节约和环境保护相关产品的企业。具体的指标包括废水排放量、废气排放量、固体废弃物排放量、资源消耗率、单位产值废水排放率、单位产值废气排放率等;

人力资源利用能力:重点关注技术密集型企业,兼顾劳动密集型企业。具体的指标包括研发、技术人员数量和占比、员工培训支出、知识水平程度、业务熟练水平等。

b. 企业基本因素判断:规模、产能、管理、竞争优势等。

3)行业配置策略

重点关注国家产业结构调整中鼓励类行业,同时也兼顾有先进企业的传统行业。最后优选成长性高、有持续成长能力且估值合理的先进企业作为本基金最终的投资组合,并进行定期调整。

(3)债券投资策略

本基金将通过大资产配置、分类资产配置和个券选择三个层次自上而下进行债券投资管理,以实现稳定收益和充分流动性的投资目标。

大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货币资产和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。

品种选择上,主要通过利率趋势分析、投资人偏好分析、对收益率曲线形态变化的预期、信用评估、市场收益率定价、流动性分析,筛选出流动性良好,成交活跃、符合目标久期、到期收益率有优势且信用风险较低的券种。

主要采用的投资策略包括:

1)久期灵活管理:在对宏观经济趋势、金融货币政策和利率趋势的判断基础上,确定债券组合久期目标范围,在可接受范围内可以按照市场实际变化灵活管理久期长短,以获取市场超额收益。

2)曲线合理定价:按照市场各品种实际成交情况,得出合理收益率曲线,使用该曲线对备选品种进行合理定价,确定其公允价格,在此基础上筛选出价格低于其合理价值的品种。

3) 曲线下滑策略:对收益率曲线形态进行分析,并预测其未来形态变化,选择收益率曲线段上斜率最高区间进行下滑操作,买入曲线上端品种,等待其剩余年期缩短而自然形成收益率下滑,从而得到超额下滑利润。

5、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准是新上证综指收益率。

新上证综指是我国证券市场由权威机构发布的反映股权分置改革实施后公司概况的指数,当前由沪市所有G股组成,此后实施股权分置改革的股票将在方案实施后的第二个交易日纳入指数。指数以总股本加权计算。随着股权分置改革的全面推进,将不断有新的样本股加入新上证综指;在不远的将来,随着市场大部分上市公司完成股改,新上证综指将逐渐成为主导市场的核心指数。

当市场出现更合适、更权威的比较基准时,本基金管理人有权选用新的比较基准,并将及时公告。

6、风险—收益特征

本基金是一只主动投资的混合型基金,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。

(二)投资程序

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和资产配置做出决策。

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,定期将股票排名结果提交给研究部和基金经理。

3、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)、重大技术发明等,撰写宏观研究报告,就基金的股票、债券、现金比例提出建议。

行业研究人员根据金融工程部定期提交的股票排名,以排名靠前的股票为主要研究对象,考察上市公司的基本面和长期发展前景,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。

4、基金经理小组负责投资执行

基金经理小组根据宏观经济和行业发展,结合量化分析等工具对股市做出判断,提出投资组合的资产配置比例建议,同时结合数量分析模型的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。

5、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。

6、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。

(三)投资限制与禁止行为

1、组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点,通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。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证券,其市值不超过基金资产净值的10%;

(2)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%;

(3)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券总和,其市值不超过该证券的10%;

(4)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%;

(5)本基金股票、权证、债券、现金的投资比例范围为:股票占基金资产净值的60%—95%,权证占0%—3%,债券及现金占5%—40%(其中现金或者到期日在一年内的政府债券占5%以上);

(6)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过基金总资产,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;

(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)本基金资产总值不超过本基金资产净值的140%;

(9)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;

(10)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%;

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

(12)法律法规或中国证监会对上述比例限制另有规定的,应从其规定。

除上述第(9)、(11)项外,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述(1)-(5)项规定的投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。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6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

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。

(四)基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

(五)基金管理人代表基金行使股东权利的原则及方法

1、不谋求对上市公司的控股,不参与上市公司的经营管理;

2、有利于基金财产的安全与增值;

3、独立行使股东权利,保护基金投资人的利益;

4、基金管理人按照有关规定代表基金出席上市公司股东大会,行使股东权利,履行股东义务。

(下转B54版)