华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金之医疗A与医疗B上市交易公告书

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
登记结算机构:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:深圳证券交易所
上市日期:2015年6月8日
公告日期:2015年6月3日

一、重要声明与提示

《华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金之医疗A与医疗B上市交易公告书》(以下简称“本公告”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号《上市交易公告书的内容与格式》》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)管理人华宝兴业基金管理有限公司的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中国银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金之医疗A与医疗B上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

本公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本公告未涉及的有关内容,请投资者详细查阅刊登在2015年5月6日《上海证券报》和《中国证券报》及华宝兴业基金管理有限公司网站(www.fsfund.com)上的《华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金招募说明书》以及同日发布在本公司网站(www.fsfund.com)上的《华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)。

二、基金概览

1、基金名称:华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金
2、基金类别:股票型
3、基金运作方式:契约型开放式
4、本基金的基金份额包括华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金之基础份额(即“华宝医疗份额”,场内简称“医疗分级”,基金代码:162412)、华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(即“华宝医疗A份额”,场内简称“医疗A”,基金代码:150261)与华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金之积极收益类份额(即“华宝医疗B份额”,场内简称“医疗B”,基金代码:150262)。华宝医疗A份额与华宝医疗B份额的份额配比始终保持1:1的比例不变。
5、基金存续期限:不定期。
6、华宝医疗A份额、华宝医疗B份额与华宝医疗份额的资产合并运作。
7、本基金通过场外、场内两种方式公开发售。投资者场外认购所得的份额,将被确认为华宝医疗份额。投资者场内认购所得的份额,将按照1:1的份额配比自动分离为华宝医疗A份额和华宝医疗B份额。基金合同生效后,投资者认购所得的华宝医疗份额场内份额的自动分离,由基金管理人委托注册登记机构进行,无需基金份额持有人申请。
8、基金合同生效后,华宝医疗份额(场内简称:医疗分级,基金代码:162412)设置单独的基金代码,只可以进行场内与场外的申购和赎回,不上市交易。华宝医疗A份额(场内简称:医疗A;交易代码:150261)与华宝医疗B份额(场内简称:医疗B;交易代码:150262)只可在深圳证券交易所上市交易,不可单独进行申购或赎回。
9、华宝医疗份额的申购与赎回:投资者可通过场外或场内两种方式,申购或赎回华宝医疗份额(场内简称:华宝医疗,基金代码:162412)。办理华宝医疗份额场内申购、赎回业务的代销机构为具有基金代销业务资格且经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位。办理华宝医疗份额场外申购、赎回业务的机构为直销机构和场外代销机构。本基金不对华宝医疗A份额或华宝医疗B份额单独开放场内申购、赎回。
10、场内份额配对转换:场内份额配对转换是指本基金场内的华宝医疗份额与华宝医疗A份额、华宝医疗B份额之间进行转换的行为,包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其在场内持有的每2份华宝医疗份额申请转换成1份华宝医疗A份额与1份华宝医疗B份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每1份华宝医疗A份额与1份华宝医疗B份额申请转换成2份场内华宝医疗份额的行为。
11、基金份额折算:基金份额定期折算的频率为每年折算1次。基金份额不定期折算的条件是华宝医疗份额的基金份额净值达到1.5000元或以上,或华宝医疗B份额的基金份额参考净值跌至0.2500元或以下。有关基金份额折算的约定,参见基金合同“第二十一部分 基金份额的折算”。定期折算基准日或不定期折算基准日的具体日期,详见基金管理人届时发布的公告。
12、基金份额总额:截至2015年6月1日,本基金的份额总额为2,003,129,905.11 份;其中,华宝医疗份额为1,066,496,345.11份;华宝医疗A份额为468,317,280.00份;华宝医疗B份额为468,317,280.00份。
13、基金份额净值:截至2015年6月1日,华宝医疗份额的基金份额净值为1.0068元,华宝医疗A份额的基金份额参考净值为 1.0021元,华宝医疗B份额的基金份额参考净值为1.0116元。
14、本次上市交易的基金份额简称及交易代码:份额简称:医疗A,交易代码:150261;份额简称:医疗B,交易代码:150262。
15、本次上市交易份额:华宝医疗A份额:468,317,280.00份;华宝医疗B份额:468,317,280.00份
16、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
17、上市交易日期:2015年6月8日
18、基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
19、基金托管人:中国银行股份有限公司
20、本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的募集与上市交易

(一)本基金募集情况
1、本基金准予募集注册的机构和文号:中国证监会证监许可【2015】596号
2、基金合同生效日:2015年5月21日
5、发售日期:2015年5月11日起至2015年5月15日
6、发售价格:人民币1.00元
7、发售方式:场内、场外认购
8、发售机构:
(1)场内销售机构
场内销售机构是指具有基金代销资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的的深圳证券交易所会员单位,具体名单可在深圳证券交易所网站查询。
(2)场外销售机构
①直销机构
本公司直销柜台和直销e网金、官方淘宝店。
②代销机构
中国银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信证券(浙江)有限责任公司、申万宏源证券有限公司、长城证券有限责任公司、中信证券(山东)有限责任公司、华宝证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、齐鲁证券有限公司、信达证券股份有限公司、江海证券有限公司、国都证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、华安证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、中航证券有限公司、兴业证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、和讯信息科技有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司。
9、验资机构名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
10、募集资金总额及入账情况
本次募集的有效净认购金额为2,002,829,982.21元人民币,折合基金份额2,002,829,982.21份;利息结转份额299,922.90份,总确认份额为2,003,129,905.11份。上述有效净认购资金及认购款项在募集期间产生的利息已于2015年5月21日全额划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金托管专户。
本基金通过场外、场内两种方式公开发售,按照每份基金份额1.00元计算,本基金募集期间含本息共募集2,003,129,905.11份基金份额,其中场外认购的基金份额为1,066,495,345.11份;场内认购的基金份额为936,634,560.00份。
11、本基金募集备案情况
本基金于2015年5月21日验资完毕,2015年5月21日向中国证监会提交了验资报告,办理基金备案手续,并于2015年5月21日获得《关于华宝兴业中证医疗指数分级证券基金备案确认的函》(机构部函[2015]1467号)的书面确认,本基金基金合同自该日起正式生效。
12、基金合同生效日:2015年5月21日
13、基金合同生效日的基金份额总额:2,003,129,905.11份
(二)本基金日常申购、赎回情况
本基金将于2015年6月8日开放日常申购、赎回业务,详细信息请投资者查阅刊登在2015年6月3日《上海证券报》和《中国证券报》及本公司网站(www.fsfund.com)上的《华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金开放日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告》。
(三)本基金上市交易的主要内容
1、基金上市交易的核准机构和核准文号:深圳证券交易所深证上[2015]245号
2、上市交易日期:2015年6月8日
3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所。
4、份额简称:医疗A,交易代码:150261 份额简称:医疗B,交易代码:150262 。
5、本次上市交易份额:华宝医疗A份额:468,317,280.00份;华宝医疗B份额:468,317,280.00份(截至2015年6月1日)。
6、未上市交易份额的流通规定:对于托管在场内的华宝医疗份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其分拆为华宝医疗A份额和华宝医疗B份额即可上市流通;对于托管在场外的华宝医疗份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其转托管至深圳证券交易所场内后分拆为华宝医疗A份额和华宝医疗B份额即可上市流通。
7、基金资产净值的披露:在华宝医疗A份额、华宝医疗B份额上市交易后或开始办理华宝医疗份额申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日的华宝医疗份额的基金份额净值和基金份额累计净值、华宝医疗A份额和华宝医疗B份额的基金份额参考净值,并在深交所行情发布系统揭示。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一)持有人户数
截至2015年6月1日,本基金之华宝医疗份额的持有人总户数为20,297户,其中场外持有人总户数为15,229户;华宝医疗A份额持有人总户数为5,066户,全部为场内持有人;华宝医疗B份额持有人总户数为5,066户,全部为场内持有人;华宝医疗份额平均每户持有的场外基金份额为70,030.56份,医疗A平均每户持有的场内基金份额为92,443.20份,医疗B平均每户持有的场内基金份额为92,443.20份。
(二)持有人结构
1、截至2015年6月1日,场内基金份额持有人结构如下:
华宝医疗A份额:场内机构投资者持有的基金份额76,421,524.00份,占比16.32%;场内个人投资者持有的基金份额391,895,756.00份,占比83.68%。
华宝医疗B份额:场内机构投资者持有的基金份额76,421,529.00份,占比16.32%;场内个人投资者持有的基金份额391,895,751.00份,占比83.68%。
2、截至2015年6月1日,基金管理人的从业人员持有本基金场内份额的情况如下:

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占场内总份额比例(%)
基金管理公司所有从业人员持有本基金	华宝医疗份额	0	0
	华宝医疗A份额	0	0
	华宝医疗B份额	0	0
	合计	0	0

(三)截至2015年6月1日,场内华宝医疗A份额前十名持有人情况

序号	持有人名称	持有份额(份)	占场内总份额比例(%)
1	王勇刚	15,001,166.00	3.20
2	中信信托有限责任公司-上海建行822	12,600,244.00	2.69
3	新余市容大投资管理中心(有限合伙)	10,000,777.00	2.14
4	中银保险有限公司-传统保险产品	10,000,083.00	2.14
5	天津易鑫安资产管理有限公司-易鑫安资管鑫安6期	7,500,145.00	1.60
6	中信信托有限责任公司-(0811全配01)	5,550,107.00	1.19
7	李星影	5,373,366.00	1.15
8	清华大学教育基金会	5,000,340.00	1.07
9	朱俭峨	5,000,097.00	1.07
10	中信信托有限责任公司-支支打07信托产品	4,400,086.00	0.94

截至2015年6月1日,场内华宝医疗B份额前十名持有人情况

序号	持有人名称	持有份额(份)	占场内总份额比例(%)
1	王勇刚	15,001,167.00	3.20
2	中信信托有限责任公司-上海建行822	12,600,245.00	2.69
3	新余市容大投资管理中心(有限合伙)	10,000,778.00	2.14
4	中银保险有限公司-传统保险产品	10,000,083.00	2.14
5	天津易鑫安资产管理有限公司-易鑫安资管鑫安6期	7,500,146.00	1.60
6	中信信托有限责任公司-(0811全配01)	5,550,108.00	1.19
7	李星影	5,373,365.00	1.15
8	清华大学教育基金会	5,000,340.00	1.07
9	朱俭峨	5,000,097.00	1.07
10	中信信托有限责任公司-支支打07信托产品	4,400,085.00	0.94

注:以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人介绍

(一)基金管理人
1、公司概况
名称:华宝兴业基金管理有限公司?
法定代表人:郑安国?
总经理:HUANG Xiaoyi Helen(黄小薏)
注册资本:人民币15亿元?
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
设立批准文号:中国证监会证监基金字[2003]19号
工商登记注册的法人营业执照文号:310000400034472
经营范围:发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务(涉及行政许可的凭许可证经营)
成立日期:2003年3月7日
股东名称及其出资比例:中方股东华宝信托有限责任公司持有51%的股份,外方股东法国领先资产管理有限公司持有49%的股份。
2、内部组织结构及职能
公司下设25个部门,包括:国内投资部、固定收益部、机构投资部、研究部、量化投资部、国际业务部、监察稽核部、风险管理部、北京分公司、深圳分公司(中西部、北方、华南、华东等投资服务中心)、机构及海外销售部、产品开发部、专户管销部、战略策划部、市场支持部、电子商务部、交易部、清算登记部、信息技术部、财务部、人事行政部。
各部门主要职责概述如下:
国内投资部:主要负责国内主动权益基金的投资管理。
固定收益部:主要负责固定收益产品的投资研究研工作。
机构投资部:主要负责非公募产品的投资管理和投资咨询工作。
研究部:主要负责宏观经济、行业及上市公司研究。
量化投资部:主要负责管理主动和被动量化基金产品、开展数量化投资策略研究的部门。
国际业务部:主要主要负责QDII基金的投资研究工作。
监察稽核部:主要负责公司内控的评估及相应制度完善。
风险管理部:主要负责公司投资组合的风险评估并提供风险管理建议。
北京分公司:主要负责维护公司在北方地区国内销售渠道。
深圳分公司:主要负责维护公司在南方地区销售渠道。
机构及海外销售部:主要负责向机构客户销售公募产品和提供相关服务。
产品开发部:主要负责公司产品战略,开发各种基金品种。
专户营销部:主要负责向机构客户、高端个人客户和渠道销售特定资产管理产品(即专户产品)。
战略策划部:主要负责公司市场营销、品牌建设、营销宣传、公关维护、渠道规划、渠道开发与维护等业务,还负责公司市场人员的KPI考核、费用管理、市场部内部事务支持等工作。
市场支持部:主要负责Call Center的管理和客户服务工作。
电子商务部:主要负责公司基金电子直销业务。
交易部:主要负责所有投资组合的交易管理。
清算登记部:主要负责基金交易的资金调拨、交易清算;组织基金会计核算。
信息技术部:主要负责公司信息系统的系统开发和日常维护。
财务部:主要负责公司财务管理、会计核算和资金管理。
人事行政部:主要负责公司人力资源管理和行政管理。
3、主要人员情况截止2015年3月31日,公司共有员工187人,其中博士及博士以上有7人,硕士107人,本科65人,专科及以下8人。
4、信息披露负责人:刘月华
电话:021-38505888
5、基金管理业务情况
截至2015年3月31日,华宝兴业基金管理有限公司旗下共管理32只开放式基金,资产管理规模为807亿元。旗下管理的基金有华宝兴业宝康消费品证券投资基金、华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金、华宝兴业宝康债券投资基金、华宝兴业动力组合股票型证券投资基金、华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金、华宝兴业现金宝货币市场基金、华宝兴业收益增长混合型证券投资基金、华宝兴业先进成长股票型证券投资基金、华宝兴业行业精选股票型证券投资基金、华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金、华宝兴业增强收益债券型证券投资基金、华宝兴业中证100指数证券投资基金、华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金、上证180价值交易型开放式证券投资基金、华宝兴业上证180价值交易型开放式证券投资基金联接基金、华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金、华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金、华宝兴业可转债债券型证券投资基金、上证180成长交易型开放式证券投资基金、华宝兴业上证180成长交易型开放式证券投资基金联接基金、华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)、华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金、华宝兴业资源优选股票型证券投资基金、华宝兴业现金添益交易型货币市场基金、华宝兴业服务优选股票型证券投资基金、华宝兴业创新优选股票型证券投资基金、华宝兴业沪深300量化中证500指数增强型证券投资基金、华宝兴业生态中国股票型证券投资基金、华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝兴业高端制造股票型证券投资基金、华宝兴业品质生活股票型证券投资基金、华宝兴业稳健回报灵活配置混合型证券投资基金。
6、本基金基金经理
胡洁女士,金融学硕士。2006年6月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后任交易员、高级产品经理、高级分析师、投资经理助理的职务。2012年10月起任上证180成长交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理,2015年5月起兼任华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金基金经理。
(二)基金托管人
1、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:人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整
法定代表人:田国立
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号
托管业务部总经理:李爱华
托管部门信息披露联系人:王永民
客服电话:95566
传真:(010)66594942
2、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。
3、基金托管业务经营情况
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。截至2015年3月31日,中国银行已托管328只证券投资基金,其中境内基金303只,QDII基金25只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,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。
(三)验资机构
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:中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
执行事务合伙人:杨绍信
联系电话:(021) 23238888
传真:(021) 23238800
联系人:张振波
经办注册会计师:汪楠、张振波

六、基金合同的内容摘要

详见本公告书附件。

七、基金财务状况

(一)基金费用期间费用
本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不从基金资产中支付,其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。
(二)基金上市前重要财务事项
本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
(三)基金资产负债表
本基金截至2015年6月1日的资产负债表如下:

资 产	本报告期末 2015年6月1日
资 产:	
银行存款	1,666,761,648.97
结算备付金	–
存出保证金	–
交易性金融资产	350,654,989.67
其中:股票投资	350,654,989.67
债券投资	–
资产支持证券投资	–
衍生金融资产	–
买入返售金融资产	–
应收证券清算款	–
应收利息	466,881.87
应收股利	–
应收申购款	–
其他资产	–
资产总计	2,017,883,520.51
负债和所有者权益	本报告期末 2015年6月1日
负 债:	
短期借款	–
交易性金融负债	–
衍生金融负债	–
卖出回购金融资产款	–
应付证券清算款	–
应付赎回款	–
应付管理人报酬	602,527.91
应付托管费	132,556.13
应付销售服务费	–
应付交易费用	297,890.52
应交税费	–
应付利息	–
应付利润	–
其他负债	26,983.86
负债合计	1,059,958.42
所有者权益:	–
实收基金	2,003,129,905.11
未分配利润	13,693,656.98
所有者权益合计	2,016,823,562.09
负债和所有者权益总计	2,017,883,520.51

注:1、截至2015年6月1日,基金份额净值1.0068元,基金份额总额2,003,129,905.11份。
2、本报告期自2015年5月21日起至2015年6月1日止。本基金基金合同于2015年5月21日生效,截至本报告期末本基金基金合同生效未满半年。

八、基金投资组合

截至2015年6月1日,本基金的投资组合如下:
(一)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	350,654,989.67	17.38
	其中:股票	350,654,989.67	17.38
2	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	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	1,666,761,648.97	82.60
7	其他资产	466,881.87	0.02
8	合计	2,017,883,520.51	100.00

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合
1.报告期末指数投资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	268,499,082.57	13.32
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	–	–
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	82,155,907.10	4.07
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	350,654,989.67	17.39

2.报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合
截至2015年6月1日,本基金未持有积极投资部分的股票投资。
(三)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
1.报告期末指数投资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

代码	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	300003	乐普医疗	873,939	43,801,822.68	2.17
2	300216	千山药机	456,700	33,466,976.00	1.66
3	300244	迪安诊断	238,933	31,266,772.38	1.55
4	002223	鱼跃医疗	524,462	29,511,476.74	1.46
5	300273	和佳股份	808,011	29,249,998.20	1.45
6	300015	爱尔眼科	469,396	25,966,986.72	1.29
7	300347	泰格医药	464,040	23,851,656.00	1.18
8	300171	东富龙	223,696	17,580,268.64	0.87
9	002551	尚荣医疗	324,518	16,388,159.00	0.81
10	300238	冠昊生物	311,114	15,932,147.94	0.79

2.报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
截至2015年6月1日,本基金未持有积极投资部分的股票投资。
(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合
截至2015年6月1日,本基金未持有债券投资。
(五)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债券投资明细
截至2015年6月1日,本基金未持有债券投资。
(六)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资产支持证券投资明细
截至2015年6月1日,本基金未持有资产支持证券。
(七)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
截至2015年6月1日,本基金未持有贵金属投资。
(八)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权证投资明细
截至2015年6月1日,本基金未持有权证。
(九)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。
(十)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。
(十一)投资组合报告附注
1.自基金合同生效日至2015年6月1日,本基金前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。
2.本基金前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
3.其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	466,881.87
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	466,881.87

4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
截至2015年6月1日,本基金未持有处于转股期的可转换债券。
5.报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
(1)报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
截至2015年6月1日,本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。
(2)报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
截至2015年6月1日,本基金未持有积极投资的股票。

九、重大事件揭示

本基金基金合同已于 2015年5月21日正式生效,基金管理人已于2015年5月22日在《上海证券报》、《中国证券报》刊登《华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金基金合同生效公告》。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易公后履行管理人职责做出如下承诺:
(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。
(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:
(一)严格遵守《证券基金法》、《证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。
(二)根据《证券基金法》、《公开募集证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查;如发现基金管理人违反了《证券基金法》、《公开募集证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定,将及时通知基金管理人纠正;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,基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、备查文件目录

(一)本基金备查文件包括下列文件:
1、中国证监会准予华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金募集注册的文件;
2、《华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金基金合同》;
3、《华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金托管协议》;
4、法律意见书;
5、基金管理人业务资格批件、营业执照;
6、基金托管人业务资格批件、营业执照;
7、中国证监会要求的其他文件。
(二)备查文件的存放地点和投资者查阅方式:
以上备查文件存放在基金管理人和基金托管人的办公场所,在办公时间可供免费查阅。
附件:基金合同摘要
(一)基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务
1、基金管理人的权利与义务
(1)根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:
1)依法募集资金;
2)自《基金合同》生效之日起,根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产;
3)依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;
4)销售基金份额;
5)按照规定召集基金份额持有人大会;
6)依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定,应层报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
7)在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;
8)选择、更换基金销售机构,对基金销售机构的相关行为进行监督和处理;
9)担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用;
10)依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案;
11)在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购与赎回申请;
12)依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;
13)在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资、融券;
14)以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
15)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;
16)在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户和份额配对转换等业务规则;
17)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
(2)根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于:
1)依法募集资金,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)办理基金备案手续;
3)自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;
4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
5)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;
6)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;
7)依法接受基金托管人的监督;
8)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定华宝医疗份额的基金份额净值和申购、赎回的价格,华宝医疗A份额与华宝医疗B份额的基金份额参考净值;
9)办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
10)对基金财务会计报告、季度、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;
11)保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上;
12)建立并保存基金份额持有人名册;
13)按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
14)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;
15)依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
16)按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作;
17)参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
18)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;
19)因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
20)按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿;
21)执行生效的基金份额持有人大会决定;
22)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。
3、基金份额持有人的权利与义务
基金投资者持有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,即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人,直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。
同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。
(1)根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于:
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)依法申请赎回或转让其持有的基金份额;
4)按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集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、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁;
9)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
(2)根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于:
1)认真阅读并遵守《基金合同》,招募说明书等信息披露文件;
2)了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,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;
3)关注基金信息披露,及时行使权利和履行义务;
4)缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《