

上证180价值交易型开放式指数证券投资基金招募说明书 (更新) 摘要

2016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：中国工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〔2010〕227号文的核准，进行募集。

基金管理人保证《上证180价值交易型开放式指数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。本基金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，投资者若在本基金前，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，基金管理人及基金托管人因操作不当而产生的基金管理人风险，基金的特有风险等等。本基金为股票基金，其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合基金。本基金在股票基金中属于指数基金，紧密跟踪标的指数，属于股票基金中风险较高、收益与标的指数所代表的股票市场水平最接近的产品。

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。

基金管理人承诺恪尽职守、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，投资者申购本基金时应认真阅读本基金招募说明书。

本招募根据《基金合同》及《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，并接受《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规范性文件、承诺义务；基金管理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2016年10月23日，有关财务数据和净值表现截止日为2016年9月30日，数据未经审计。

一、《基金合同》生效日期
本基金基金合同于2010年4月23日正式生效。

二、基金管理人
(一) 基金管理人概况
名称：华宝兴业基金管理有限公司
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56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56楼
法定代表人：郑安国
总经理：HUANG Xiaoyi Helen（黄小意）
成立日期：2003年3月7日
注册资本：1.5亿元
电话：021-38506888
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，外方股东领先资产管理股份有限公司持有49%的股份。

(二) 基金管理人主要人员情况
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助理，华宝信托投资管理有限公司副总经理、总经理、总裁、董事长，华宝信托投资管理有限公司总经理。现任华宝兴业基金管理有限公司董事长，中国太平保险(集团)股份有限公司董事长。

HUANG Xiaoyi Helen（黄小意）女士，董事，硕士。曾任加拿大TD Securities公司金融分析师，Achorp投资公司财务总监，2003年6月加入华宝信托投资管理有限公司，曾任公司营运总监、董事兼秘书、副总经理，现任公司董事。

Lionel PAQUIN先生，董事，硕士。曾在法国财政部、法国兴业银行、领先资产管理有限责任公司从事监察、风险管理等职务平台等业务，现任领先资产管理有限责任公司总裁。

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；曾任法国兴业银行全球市场执行董事。2013年8月加入华宝兴业基金管理有限公司任总经理高级顾问。现任公司常务副总经理。

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、上海市邦信律师事务所律师，现任上海阳光律师事务所主任、首席合伙人。

郑安宇先生，独立董事，博士。曾任宁夏广播电视台主讲师，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，荷兰合作银行东亚区食品饮料研究主管，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。现任上海合谊投资管理有限公司董事长。

陈志宏先生，独立董事，硕士。曾任华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。现任华彬国际投资（集团）有限公司高级顾问。

2. 监事会成员
Anne MARION-BOUCHACOURT女士，监事，硕士。曾任普华永道总监，杰米尼咨询金融结构业务副总裁，杰米尼国际财务总监，负责集团人力资源部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。

殷正洪先生，监事，本科。曾任宝钢集团财务部主、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、宝钢集团办公厅主任等主任。现任华宝投资有限公司总经理助理。

黄佳先生，监事，毕业于江西财经大学。曾任华宝信托投资有限责任公司研究部副总经理。现任华宝兴业基金管理有限公司营运副总监。

3. 高级管理人员
郑安国先生，董事长，简历同上。
HUANG Xiaoyi Helen（黄小意）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副经理，华宝信托投资有限责任公司发展研究中心总经理兼投资管理部总经理、华宝信托投资有限责任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，曾任华宝兴业中证全指证券投资基金基金经理。现任华宝兴业基金管理有限公司总经理兼投资总监。

向辉先生，副总经理，硕士。曾在武汉长江金融证券事务所任副所长，在长盛基金管理有限责任公司市场部任职。2002年加入华宝兴业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。现任公司副总经理。

刘卫强先生，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。

4. 本基金基金经理
丰建斌，硕士。2009年加入华宝兴业基金管理有限公司，先后担任资产管理经理、数量分析师、投资经理助理、投资经理等职务。2015年11月任华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2016年8月任华宝兴业中证全指证券投资基金交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

6. 权益投资决策委员会成员
任志强先生，副总经理，投资总监。
刘卫强先生，投资副总监、华宝兴业动力组合混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业高端制造股票型证券投资基金基金经理、华宝兴业国策导向混合型证券投资基金基金经理。
同旭女士，助理投资总监、国内投资部总经理、华宝兴业行业精选混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业成长升级混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业稳健回报混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业稳健回报混合型证券投资基金基金经理。
胡光游先生，助理投资总监，华宝兴业宝康消费品证券投资基金基金经理，华宝兴业品质生活股票型证券投资基金基金经理、华宝兴业核心优势灵活配置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、基金托管人
(一) 基金托管人基本情况
名称：中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间：1904年1月1日
法定代表人：姜念海
注册资本：人民币35,640.62571亿元
联系电话：010-66106799
联系人：洪澜
(二) 主要人员情况
截至2016年9月末，中国工商银行资产托管部共有员工210人，平均年龄30岁，95%以上为工科大学本科学历以上，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

(三) 基金托管业务经营情况
作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系，规范的管理模式，先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企事业单位提供安全、高效、专业的托管服务，获得优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最早、最成熟、规模最大的托管服务体系，拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、企业年金基金、QDII资产、QDLP资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2016年9月，中国工商银行托管证券投资基金达624只。自2003年以来，本行连续十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等海内外权威财经媒体评选的51项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

四、相关服务机构
(一) 基金销售机构
1. 申购赎回代理券商（简称“一级交易商”）
(1) 国泰君安证券股份有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号 ●办公地址：上海市浦东新区世纪大道168号上海银行大厦29楼 ●法定代表人：杨德红 ●客服电话：95521
网址：www.gtja.com
(2) 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
客户服务电话：95525、4008888788、10109989
公司网址：www.ebscn.com
(3) 海通证券股份有限公司
注册地址：上海市中路98号

法定代表人：崔秋平
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
(4) 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：黄群慧
客户服务电话：4008888111、95565
公司网址：www.newone.com.cn
(5) 广发证券股份有限公司
注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场4楼（4301-4316房）
办公地址：广东省广州天河区北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
联系人：黄晨
统一客户服务热线：95575或致电各地营业网点
公司网址：http://www.gf.com.cn
(6) 长江证券股份有限公司
注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：崔肖华
电话：027-65799999
传真：027-85481900
联系人：奚博宇
客户服务电话：95579或4008-888-999
公司客服电话：www.95579.com
(7) 申万宏源证券有限公司
注册地址：上海市虹口区东长治路568号909号45层（邮编：200031）
办公地址：上海市虹口区东长治路568号909号45层（邮编：200031）
法定代表人：李梅
电话：021-33389888
传真：021-33388222
客服电话：95523或4008895523
电话委托：021-962505
国际互联网网址：www.swhysc.com
(8) 平安证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层；
办公地址：深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层；
法定代表人：谢永林
联系人：周永
电话：0755-22695236
全国免费业务咨询电话：95511-8
开放式基金业务传真：0755-82436367
公司网址：www.stock.pingan.com
(9) 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.ciccitic.com
(10) 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：胡月娟
电话：021-63325888
传真：021-63326729
客户服务电话：95503
公司网址：www.dfzq.com.cn
(11) 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：0591-28121963
联系人：廖江
电话：0591-82139632
传真：0755-82133962
客户服务电话：95536
国信证券网站：www.guosen.com.cn
(13) 中信证券（山东）有限责任公司
注册地址：青岛市市南区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼第20层
办公地址：青岛市市南区深圳路222号青岛国际金融中心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：0532-85022366
传真：0532-85022605
客户咨询电话：95548
公司网址：www.citissd.com
(14) 华泰证券股份有限公司
注册地址：南京市江东中路228号
法定代表人：周易
电话：0755-82492193
传真：0755-82492662
联系人：庞晓芸
公司网址：http://www.htsec.com.cn
(二) 律师事务所及经办律师
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
电话：(86 21) 3135 8666
传真：(86 21) 3135 8600
联系人：李 明
(四) 会计师事务所及经办注册会计师
名称：安永华明会计师事务所
法定代表人：魏明
住所：北京市东城区东长安街1号东方广场E座16层
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60楼
公司电话：021-22288888（注：公司总机）
公司传真：021-22280001（注：传真总机）
签字会计师：徐艳、蒋燕华
业务联系人：蒋燕华
五、基金简介
基金名称：上证180价值交易型开放式指数证券投资基金
基金类型：开放式指数基金
六、基金的投资
(一) 投资目标
紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
(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，包括上证180价值指数的成份股及标的指数、新股首次公开发行增发、债券、以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。法律法规或监管机构以后允许本基金投资的其他品种，本基金管理人将在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
本基金投资于上证180价值指数的成份股及标的指数的资产比例不低于该基金资产净值的95%，同时为了更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。
(三) 投资策略
1. 股票资产数字化投资策略
本基金根据标的指数的编制规则，采用完全复制制的方法跟踪标的指数的表现。通常情况下，本基金根据标的指数的成份股在指数中的权重确定成份股的投资，通常情形下，本基金根据标的指数的成份股及权重的变动进行相应调整。在因特殊情形（如成份股停牌、流动性不足、无法及时获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，经综合考虑后，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代（同行业股票优先考虑），以期在规定的风险承受度之内，尽量缩小跟踪误差。
2. 债券投资策略
本基金基于流动性管理及预期性投资的需要，将投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券，债券投资的目的在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。
3. 其他金融工具投资策略
在法律法规许可下，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，以提供投资组合的优化调整，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。本基金管理人运用上述金融衍生工具必须出于追求基金充分分散投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不得应用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。
(四) 投资管理
本基金采用完全复制法进行指数化投资，按照成份股在上证180价值指数中的基准权重构建指数化投资组合。当前期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人应在10个交易日日内对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。
1. 标的指数定期调整
根据标的指数的编制规则及调整公告，本基金在指数成份股调整生效前，分析并确定对投资组合调整策略，及时进行投资组合的优化调整，减少流动性冲击，尽量减少标的指数成份股变动所带来的跟踪偏离度和跟踪误差。
2. 成份股公司信息日常跟踪与分析
跟踪标的指数成份股公司信息（如：股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌等），以及成份股公司其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，并根据这些信息确定基金投资组合每日交易策略。
3. 标的指数成份股临时调整
根据标的指数的编制规则及调整公告，本基金在指数成份股临时调整的情形，本基金管理人将密切跟踪本股票的调整，并及时作出相应的投资组合调整策略。
4. 申购赎回情况的跟踪与分析
跟踪本基金申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，分析其对组合的影响，制定交易策略以应对基金的申购赎回。
5. 跟踪偏离度的监控与管理

每日跟踪基金组合与标的指数的表现的偏离度，每月末、季末定期分析基金的实际情况与标的指数的表现偏离度，跟踪误差变化情况及其原因，并优化跟踪偏离度管理方案。

在正常情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差率不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

(五) 标的指数
本基金的标的指数为上证180指数系列中的上证180价值指数（指数代码为000029.SSH）。

上证180风格指数是由中证指数公司编制并发布。它以上证180指数为样本空间，其包含4只指数，包括：上证180成长指数、上证180价值指数、上证180相对成长指数和上证180相对价值指数。其中，上证180价值指数是从上证180指数样本中，挑选最具代表性的60只价值股票形成指数。该指数从风格特征的角度进一步刻画了上证180指数，也为投资者提供了新的业绩基准和资产配置工具。

随着市场环境的变化，如果上述的指数不适用本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，进行适当的程序变更本基金的标的指数，并同时更换基金的基金名称与业绩比较基准。其中，若标的指数变更涉及及本系列投资价值范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会核准或备案。若标的指数变更对基金份额持有人权益无实质性影响且不会对基金份额持有人利益产生重大影响的，基金管理人可不经召开基金份额持有人大会，基金管理人应在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案，并应至少提前30个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

(六) 投资限制
1. 禁止行为
为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：
(1) 承销证券；
(2) 向他人贷款或提供担保；
(3) 从事内幕交易、操纵市场等不正当的交易；
(4) 买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
(5) 向基金管理人、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债券；
(6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销前承销的证券；
(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及不正当的证券交易活动；
(8) 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

对于因上述(5)、(6)项情形导致无法提前指出的指数成份股或备选成份股，基金管理人将在严格控制跟踪误差的前提下，将结合使用其他合理方法进行适当替代。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后，可不受上述规定的限制。

2. 投资组合限制
本基金的投资组合将遵循以下限制：
a. 本基金在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%；
b. 本基金在任交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；
c. 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%；
d. 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%；
e. 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规模的10%；
f. 本基金财产参与股指期货交易，所申报的金额不得超过本基金总资产，所申报的股指期货数量不得超过股指期货股票公司本发行股票的总量；
g. 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；
h. 相关法律法规及监管部门规定的其它投资限制。
如法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制。

基金管理人应当自《基金合同》生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合《基金合同》的约定。由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动、标的指数成份股调整等基金管理人之外原因导致的投资组合不符合上述约定的比例的，基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到标准。对于因基金份额拆分等集中持续申购活动引起的基金资产规模在10个交易日内增加10亿元以上的情形，而导致证券投资比例低于基金合同约定的，基金管理人履行相关程序后可将调整时限从10个交易日延长到3个月。法律法规另有规定的从其规定。

(七) 业绩比较基准
本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数变更的，业绩比较基准随之变更并公告。

(八) 风险收益特征
本基金为股票基金，其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合基金。本基金在股票基金中属于指数基金，紧密跟踪标的指数，属于股票基金中风险较高、收益与标的指数所代表的股票市场水平大致相近的产品。

七、基金投资组合报告
本投资组合报告所载数据截至2016年9月30日，本报告中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	137,276,711.38	98.40
	其中：股票	137,276,711.38	98.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	银行存款	-	-
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	银行存和拆借备付金合计	2,229,576.59	1.60
8	其他资产	2,600.44	0.00
9	合计	139,510,888.41	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合
(1) 报告期末股票投资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	-	-
B	采矿业	5,677,233.76	4.08
C	制造业	11,367,367.16	8.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,230,773.02	6.64
E	建筑业	6,544,284.28	4.71
F	批发和零售业	509,374.00	0.37
G	交通运输、仓储和邮政业	4,307,040.18	3.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,520,406.45	1.09
J	金融业	89,326,846.68	64.18
K	房地产业	8,304,777.83	5.97
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	137,276,711.38	98.74

(2) 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合
本基金期末未持有积极投资部分的股票投资。
(3) 报告期末按行业分类的沪港通股票投资组合
本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。
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
(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

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	601318	中国平安	416,406	14,224,420.06	10.23
2	600016	民生银行	1,021,743	9,140,244.18	6.61
3	601166	兴业银行	577,362	9,220,314.44	6.63
4	600036	招商银行	446,636	8,021,430.00	5.77
5	601328	交通银行	1,189,040	6,077,360.00	4.43
6	600000	浦发银行	374,336	6,127,000.00	4.44
7	601288	农业银行	1,662,134	5,174,146.12	3.72
8	601199	招商行	526,794	4,794,634.40	3.44
9	601298	工商银行	1,050,600	4,764,150.00	3.36
10	600900	长江电力	303,701	4,039,223.30	2.91

(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

本基金本报告期末未持有积极股票投资。
4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券投资。
5. 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
本基金本报告期末未持有债券投资。
6. 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
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序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证投资。
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。
(3) 本基金投资股指期货的投资情况
本基金本报告期末未持有股指期货。
(1) 本期股指期货投资政策
本基金未投资股指期货。
(2) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
(3) 本期股指期货投资持仓
(1) 上证180价值ETF基金截至2016年9月30日持仓前十名证券中的招商银行(600036)于2016年1月9日收到中国证监会《关于对招商银行股份有限公司长春分行采取责令改正措施的决定》。由于吉林省分行在从人员资质、销售材料、业务流程等多项内容上存在问题，现要求该行进行改正，并于2016年1月31日前，向吉林证监局报送整改情况的书面报告，并等待检查验收。
上证180价值ETF基金截至2016年9月30日持仓前十名证券中的农业银行(601288)于2016年1月23日发布公告，北京分行卷入买入债券业务发生重大风险

事件，涉及风险金额为39.15亿元，公安机关已立案侦查。

上证180价值ETF基金截至2016年9月30日持仓前十名证券中的民生银行(600016)于2016年8月11日收到北京证监局向公司下发监管关注函（京证监发2016〔175〕）《关于对中国民生银行股份有限公司的监管关注函》，要求民生银行完善公司治理结构，尽快落实独立董事的选聘。

民生银行(600016)于2016年7月26日收到上海证券交易所下发监管工作函（上证公函〔2016〕0879号）《关于中国民生银行股份有限公司加强规范运作的监管工作函》，对公司加强规范运作事项提出监管要求。

民生银行(600016)于2016年7月26日收到中国证券投资基金业协会向加银资管下发纪律处分决定书（中基协处分〔2016〕15号），加银资管部分资产管理计划违规开展资金池业务，违反了中国证监会《关于进一步加强基金管理公司及其子公司从事特定客户资产管理业务风险管理的通知》和《证券投资基金销售机构落实资产管理业务“八条底线”禁止行为细则（2015年9月版）》等相关规定，采取暂停加银资管资产管理计划备案6个月，并责令清盘资金池业务的行政监管措施。

民生银行(600016)于2016年7月19日收到上海证券交易所向公司下发监管工作函（上证公函〔2016〕0861号）《关于中国民生银行股份有限公司股东增持事项的监管工作函》，要求公司督促股东披露增持公司股份有关事项。

民生银行(600016)于2016年5月17日收到中国证监会向加银资管下发行政监管措施决定书（〔2016〕49号）《关于对民生证券资产管理有限公司采取暂停办理相关业务措施的决定》，对加银资管部分资产管理计划较高比例投资于非标准资产，但超每周开放申购赎回，违反了《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》相关规定，对此采取责令改正、暂停办理加银资管特定客户资产管理计划备案3个月的行政监管措施。

民生银行(600016)于2016年4月18日收到深圳证监局向加银基金下发行政监管措施决定书（〔2016〕22号）《深圳证监局关于对民生加银基金管理有限公司采取出示警示函行政监管措施的决定》，因中国证监会深圳证监局出具的《民生加银基金信息系统渗透测试报告》显示加银基金存在多项信息安全漏洞，违反了《证券期货信息安全保障管理办法》相关规定，深圳证监局决定采取出具警示函的行政监管措施。

上证180价值ETF基金截至2016年9月30日持仓前十名证券中的工商银行(601398)于2016年1月6日收到吉林证监局对中国工商银行股份有限公司吉林省分行采取责令改正措施的决定。因中国工商银行股份有限公司吉林省分行存在未及在网站更新基金销售人员资质情况，部分从事基金销售业务的人员未取得基金销售业务资格等问题，责令改正。

本基金为交易型开放式指数证券投资基金，采用完全复制法进行指数化投资，按照成份股在上证180价值指数中的基准权重构建指数化投资组合。基金管理人对于上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。本报告期内，本基金投资的前十名证券中的其余六名证券的发行人不存在被监管部门立案调查或在本报告编制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约定的备选股票库。
(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,163.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	437.43
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	预付款	-
9	合计	2,600.44

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
(5) 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
本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。
(6) 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
本基金本报告期末积极投资股票不存在流通受限情况。
八、基金的业绩
本基金业绩数据为截止2016年9月30日的数据，本报告中列数据未经审计。
(一) 本报告期基金份额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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2010/04/23-2016/12/31	-12.56%	1.67%	-11.08%	1.67%	-1.48%	0.00%
2010/01/01-2011/12/31	-14.84%	1.28%	-15.76%	1.27%	0.92%	0.01%
2012/01/01-2012/12/31	16.46%	1.15%	13.60%	1.14%	2.86%	0.01%
2013/01/01-2013/12/31	-8.67%	1.56%	-12.73%	1.54%	4.06%	0.02%
2014/01/01-2014/12/31	73.65%	1.41%	67.47%	1.41%	6.18%	0.00%
2015/01/01-2015/12/31	2.09%	2.43%	0.47%	2.46%	1.62%	-0.08%
2016/01/01-2016/09/30	-6.16%	1.24%	-8.44%	1.26%	2.28%	-0.02%
2010/04/23-2016/09/30	30.38%	1.60%	14.39%	1.60%	15.91%	0.00%

(二) 自基金合同生效以来基金业绩比较基准增长率及其与同期业绩比较基准收益率的变动比较
华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2010年4月23日至2016年9月30日)

注：基金依法应自成立日期起6个月内达到基金合同约定的资产组合，截至2010年5月28日，本基金已达到合同约定的资产配置比例。

九、基金费用
(一) 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. 标的指数许可使用费；
4. 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
5. 《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师费和诉讼费；
6. 基金份额持有人大会费用；
7. 基金的证券交易费用；
8. 基金的银行汇划费用；
9. 基金收益分配中发生的费用；
10. 基金上市费及年费；
11. 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。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

(二) 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
本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。管理费按如下方法计算：
H=E×0.5%÷当年天数
H为每日应计提的管理费
E为前一日基金资产净值
管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2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、公休假等，支付日期顺延。

上述（一）基金费用的种类中第3—11项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

(三) 不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用：
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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
4. 其他根据相关法律法规及中国证监会有关规定不得列入基金费用的项目。

(四) 费用调整
基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。
调高基金管理费率、基金托管费率等费率，须经召开基金份额持有人会议；调低基金管理