华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）摘要

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：中国建设银行股份有限公司

【重要提示】

本基金根据2016年3月29日中国证券监督管理委员会证监许可［2016］626号的注册，进行募集。

基金管理人保证《华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本基金招募说明书”)的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金主要投资于香港证券市场，基金净值会因为香港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：政治风险、海外市场风险、政府管制风险、汇率风险、法律风险、利率风险、税务风险、境外上市公司经营风险，开放式基金的一般风险，如：流动性风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险、交易对手的信用风险、大宗交易风险等。另外，本基金为指数基金，其特定风险包括指数化投资的风险、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、标的指数编制的风险、跟踪误差的风险、标的指数变更的风险、股指期货及其他衍生品投资的风险等。本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

投资有风险，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等信息披露文件，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者的风险承受能力相适应，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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

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。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行负担。

本招募说明书摘要所载内容截止日为2018年6月24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2016年5月23日到2016年6月21日向个人投资者和机构投资者同时发售，《基金合同》于2016年6月24日生效。

二、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：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（黄小蕙）
成立日期：2003年3月7日
注册资本：1.5亿元人民币
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）基金管理人主要人员情况

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（黄小蕙）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[illegible]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[illegible]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、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[illegible]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[illegible]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[illegible]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[illegible]，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[illegible]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[illegible]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[illegible]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[illegible]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[illegible]限公司营运副总监兼北京分公司总经理兼综合管理部总经理。

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互金业务总监兼互金策划部总经理。

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（黄小蕙）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

周晶先生，经济学博士、工商管理硕士。先后在美国德州奥斯丁市德亚资本、泛太平洋证券（美国）和汇丰证券（美国）从事数量分析、另类投资分析和证券投资研究工作。2005年至2007年在华宝基金管理有限公司任内控审计风险管理部主管，2011年再次加入华宝基金管理有限公司任策略部总经理兼首席策略分析师，现任国际业务部总经理。2013年6月至2015年11月任华宝成熟市场动量优选证券投资基金基金经理，2014年9月起兼任华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)基金经理，2015年9月至2017年8月任华宝中国互联网股票型证券投资基金基金经理。2016年3月任华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金（LOF）基金经理。2016年6月兼任华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）基金经理，2017年4月任华宝港股通恒生中国（香港上市）25指数证券投资基金（LOF）基金经理，2018年3月兼任华宝港股通恒生香港35指数证券投资基金（LOF）基金经理。

5、权益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、华宝价值发现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、编制季度、半年度和年度基金报告；
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、按照规定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》、《中华人民共和国证券法》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：
（1）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；
（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
（3）利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
（5）侵占、挪用基金财产；
（6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
（7）玩忽职守，不按照规定履行职责；
（8）法律、行政法规和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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
（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，基金管理人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，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等。

3、基金管理人关于内部控制制度的声明书

（1）基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
（2）基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人发展不断完善内部控制制度。

三、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)
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：田国立
成立时间：2004年09月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号
联系人：田 青
联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2017年6月末，本集团资产总额216，920.67亿元，较上年末增加7，283.62亿元，增幅3.47%。上半年，本集团实现利润总额1，720.93亿元，较上年同期增长1.30%；净利润较上年同期增长3.81%至1，390.09亿元，盈利水平实现平稳增长。

2016年，本集团先后获得国内外知名机构授予的100余项重要奖项。荣获《欧洲货币》“2016中国最佳银行”，《环球金融》“2016中国最佳消费者银行”、“2016亚太区最佳流动性管理银行”，《机构投资者》“人民币国际化服务钻石奖”，《亚洲银行家》“中国最佳大型零售银行奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构奖”。本集团在英国《银行家》2016年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第2；在美国《财富》2016年世界500强排名第22位。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玎，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2017年二季度末，中国建设银行已托管759只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行连续11年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》“中国最佳托管银行”、“中国最佳次托管银行”、“最佳托管专家——QFII”等奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”。

二、基金托管人的内部控制制度

（一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

（二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

（三）内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

三、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

（一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

（二）监督流程

1.每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

2.收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

3.根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性和投资独立性等方面进行评价，报送中国证监会。

4.通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

四、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、场外销售机构

（1）直销机构

1）直销柜台

华宝基金管理有限公司在上海开设直销柜台。
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
直销柜台电话：021－38505731、38505732、021－38505888－301或302
直销柜台传真：021－50499663、50988055
网址：www.fsfund.com

2）直销e网金

投资者可以通过华宝基金管理有限公司网上交易直销e网金系统办理本基金的认/申购、赎回等业务，具体交易细则请参阅华宝基金管理有限公司网站公告。网上交易网址：www.fsfund.com。

（2）其他场外销售机构

（1）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：陈四清
客户电话：95566
公司网址：www.boc.cn

（2）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：田国立
客户电话：95533
公司网址：www.ccb.com

（3）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
传真：（021）58408483
客户电话：95559
公司网址：www.bankcomm.com

（4）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
客户电话：95555
公司网址：www.cmbchina.com

（5）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

（6）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
传真：021－63604196
客户电话：95528
公司网址：www.spdb.com.cn

（7）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

（8）深圳前海微众银行股份有限公司
注册地址：广东省深圳市南山区田厦金牛广场A座36楼、37楼
客户电话：400－999－8800
公司网址：www.webank.com

（9）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
传真：0755－82558355
客户电话：4008－001－001
公司网址：www.essence.com.cn

（10）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
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
传真：022－28451958
客户电话：4006515988
公司网址：http://www.ewww.com.cn

（11）财通证券股份有限公司
办公地址：浙江省杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201，501，502，1103，1601－1615，1701－1716室
注册地址：浙江省杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201，501，502，1103，1601－1615，1701－1716室
法定代表人：沈继宁
联系人：章力彬
客户电话：95336 ，4008696336
公司网址：www.ctsec.com

（12）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
客户电话：0755－33680000、400 6666 888
公司网址：www.cgws.com

（13）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
传真：027－85481900
客户电话：95579或4008－888－999
公司网址：www.95579.com

（14）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
传真：862168767981
客户电话：400－8888－128
公司网址：www.tebon.com.cn

（15）第一创业证券股份有限公司
办公地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦18层
注册地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
法定代表人：刘学民
联系人：吴军
传真：0755－25838701
客户电话：95358
公司网址：www.firstcapital.com.cn/

（16）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
传真：0431－85096795
客户电话：95360
公司网址：www.nesc.cn

（17）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
传真：021－63326729
客户电话：95503
公司网址：www.dfzq.com.cn

（18）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
传真：021－50498825
客户电话：95531；400－8888－588
公司网址：www.longone.com.cn

（19）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
传真：0512－62938527
客户电话：95330
公司网址：www.dwzq.com.cn

（20）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
传真：010－66555246
客户电话：400－8888－993、95309
公司网址：www.dxzq.net.cn

（21）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
客户电话：95571
公司网址：www.foundersc.com

（22）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
传真：021－22169134
客户电话：95525
公司网址：www.ebscn.com

（23）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
客户电话：95575或致电各地营业网点
公司网址：www.gf.com.cn

（24）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
客户电话：400－818－8118
公司网址：www.guodu.com

（25）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

（26）国金证券股份有限公司
办公地址：四川省成都市东城根上街95号
法定代表人：冉云
联系人：刘婧漪、贾鹏
传真：028－86690126
客户电话：95310
公司网址：www.gjzq.com.cn

（27）国联证券股份有限公司
办公地址：无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦
法定代表人：姚志勇
客户电话：95570
公司网址：http://www.glsc.com.cn

（28）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
传真：021－38670666
客户电话：95521
公司网址：www.gtja.com

（29）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
传真：0755－82133952
客户电话：95536
公司网址：www.guosen.com.cn

（30）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
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

（31）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
传真：0991－2301927
客户电话：400－800－0562
公司网址：www.hysec.com

（32）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
传真：0551－65161600
客户电话：95318
公司网址：www.hazq.com

（33）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
传真：021－68777822
客户电话：400－820－9898，021－38929908
公司网址：www.cnhbstock.com

（34）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

（35）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
客户电话：95597
公司网址： www.htsc.com.cn

（36）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

（37）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

（38）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

（39）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
传真：021－53686100，021－53686200
客户电话：021－962518
公司网址：www.962518.com

（40）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
传真：021－33388224
客户电话：95523、4008895523
公司网址： www.swhysc.com

（41）西南证券股份有限公司
办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
注册地址：重庆市江北区桥北苑8号
法定代表人：吴坚
联系人：张煜
传真：023－63786212
客户电话：400－8096－096、95355
公司网址：www.swsc.com.cn

（42）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
传真：010－63081344
客户电话：95321
公司网址：www.cindasc.com

（43）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

（44）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
客户电话：95551、400－8888－888
公司网址：www.chinastock.com.cn

（45）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
传真：0755－82943227
客户电话：4008895565或95565
公司网址：www.newone.com.cn

（46）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
传真：0791－86789414
客户电话：400－8866－567
公司网址：www.avicsec.com

（47）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
传真：021－20315125
客户电话：95538
公司网址：www.zts.com.cn

（48）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
传真：0755－82026539
客户电话：95532或400 600 8008
公司网址：www.china－invs.cn

（49）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

（50）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
传真：0755－83217421
客户电话：400－990－8826
公司网址：www.citicsf.com

（51）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
传真：010－60833739
客户电话：95548
公司网址：www.cs.ecitic.com

（52）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
传真：0532－85022605
客户电话：95548
公司网址：www.zxwt.com.cn

（53）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
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

（54）北京创金启富投资管理有限公司
办公地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
联系人：宋春
联系电话：18600056520
客户电话：400－6262－818
公司网址：www.5irich.com

（55）北京蛋卷基金销售有限公司
办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人：钟斐斐
联系电话：15910450297
传真：010－61840699
客户电话：4000618518
公司网址：https://danjuanapp.com/

（56）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
联系电话：400－700－9665
客户电话：400－700－9665
公司网址：www.ehowbuy.com

（57）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
联系电话：400－920－0022
客户电话：400－920－0022
公司网址：www.licaike.com

（58）上海华夏财富投资管理有限公司
客户电话：400－817－5666

（59）上海基煜基金销售有限公司
办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室
法定代表人：王翔
客户电话：400－820－5369
公司网址：www.jiyufund.com.cn

（60）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

（61）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

（62）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

（63）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

（64）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
联系电话：400－820－0025
客户电话：400－821－5399
公司网址：www.noah－fund.com

（65）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

（66）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
联系电话：400－1818－188
客户电话：400－1818－188
公司网址：www.1234567.com.cn

（67）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
联系电话：4008－773－772
客户电话：4008－773－772
公司网址：www.5ifund.com

（68）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

（69）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

（70）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

基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。

2、场内销售机构

本基金办理场内认购、申购和赎回业务的销售机构为具有基金销售业务资格、并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员。具体会员单位名单可在上海证券交易所网站查询。

本基金募集结束前获得基金销售资格的上海证券交易所会员单位可通过上海证券交易所系统办理本基金的场内认购业务。基金管理人将不就此事项进行公告。

（二）登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司
地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：周明
联系人：朱立元
电话：010－59378839
传真：010－59378907

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所
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：俞卫锋
联系电话：021－31358666
传真：021－31358600
联系人：丁媛
经办律师：黎明、丁媛

（四）审计基金财产的会计师事务所

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：华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）
基金类型：契约型开放式

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最小化。正常情况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过5%。

（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，包括标的指数成分股、备选成分股、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市场挂牌交易的其他股票、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具、回购、证券借贷、跟踪同一标的指数的股指期货等金融衍生品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(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金在投资香港特别行政区证券市场挂牌交易的股票时，在法律法规允许的前提下，既可通过合格境内机构投资者的额度进行投资，也可通过沪港股票市场互联互通机制进行投资。

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。

基金的投资组合比例为：

投资于标的指数成分股、备选成分股的资产不低于基金资产的80%。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

（三）投资策略

本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

1、组合复制策略

本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

2、替代性策略

对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。

3、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

本基金在投资的过程中，造成跟踪误差的原因主要有以下几方面：
1、基金日常运作过程中必须保有一定比例的现金资产；
2、基金投资组合的权重与目标指数的成分股的权重可能在调整周期当中出现不一致；
3、基金补券过程中股票买卖价格与股票收盘价存在差异；
4、各种交易费用及基金运作过程中所产生的费用和开支；
5、成分股红利再投资；
6、换汇过程中使用的实际汇率与估值汇率的差异等。

基金管理人会定期对跟踪误差进行归因分析，为基金投资组合下一步的调整及跟踪目标指数偏离风险的控制提供量化决策依据。

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将适当投资于债券和货币市场工具，固定收益投资的目的是在保证基金资产流动性的同时有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

同时，为更好地实现本基金的投资目标，本基金还将在条件允许的情况下，开展证券借贷业务以及投资于金融衍生品，以期降低跟踪误差水平。本基金投资于金融衍生品的目标是替代跟踪标的指数的成份股，使基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数。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。

正常情况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过5%。

未来，随着全球证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在更新的招募说明书中公告。

（四）业绩比较基准

本基金的标的指数为标普香港上市中国中小盘指数（S&P Hong Kong Listed China MidSmallCap Select Index）。

本基金的业绩比较基准为经人民币汇率调整的标普香港上市中国中小盘指数收益率×95%+人民币活期存款利率（税后）×5%。

如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制，发布或授权，或标的指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为标的指数不宜继续作为跟踪标的，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。若变更标的指数、业绩比较基准对基金投资范围和投资策略等无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。若变更业绩比较基准、标的指数涉及本基金投资范围或投资策略等实质性变更，则基金管理人应就变更业绩比较基准、标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案。

（五）风险收益特征

本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

（六）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：
（1）本基金投资于标的指数成分股、备选成分股的资产不低于基金资产的80%；
（2）保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；
（3）基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的20%。其中银行指依法设立的中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行，但在基金托管账户的存款可以不受上述限制；
（4） 本基金持有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以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的3%；
（5）本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的10%。前述非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产；
（6）本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金净值的10%。持有货币市场基金可以不受上述限制；
（7）基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的20%；
（8）为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的10%。

2、金融衍生品投资

本基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理，不得用于投机或放大交易，同时应当严格遵守下列规定：
（1）本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的100%。
（2）本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的10%。
（3）本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：
1）所有参与交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级。
2）交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易。
3）任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的20%。
（4）基金管理人应当在本基金会计年度结束后60个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。
（5）本基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品。

3、本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：
（1）所有参与交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。
（2）应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的102%。
（3）借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。
（4）除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：
1）现金；
2）存款证明；
3）商业票据；
4）政府债券；
5）中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。
（5） 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。
（6）基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

4、基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：
（1）所有参与正回购交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。
（2）参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留现金以满足索赔需要。
（3）买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。
（4）参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置该证券以满足索赔需要。
（5）基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

5、基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的50%。前述比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

6、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

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。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。若基金超过上述1-5项投资比例限制，应当在超过比例后30个工作日内采用合理的商业措施以符合投资比例限制要求。基金托管人根据《托管协议》对基金的投资进行监督和检查，对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

7、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：
（1）承销证券；
（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
（3）从事承担无限责任的投资；
（4）购买不动产；
（5）购买房地产抵押按揭；
（6）购买贵重金属或代表贵重金属的凭证；
（7）购买实物商品；
（8）除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金。临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的10%；
（9）利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
（10）参与未持有基础资产的卖空交易；
（11）购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层；
（12）直接投资与实物商品相关的衍生品；
（13）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；
（14）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

（七）经基金管理人公告有关规则及事项，本基金可以依据法律法规的规定参与融资。

（八）基金管理人代表基金行使股东和债权人权利的处理原则及方法
1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
2、有利于基金资产的安全与增值；
3、基金管理人按照有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
4、基金管理人按照有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

（九）代理投票

基金管理人应作为基金份额持有人的代理人，行使所投资股票的投票权。基金管理人将本着维护持有人利益的原则，勤勉尽职地代表基金份额持有人行使投票权。在履行代理职责过程中，基金管理人可根据操作需要，委托境外资产托管人或其他专业机构提供代理投票的建议、协助完成代理投票的程序等，基金管理人应对代理机构的行为进行必要的监督，并承担相应责任。

（十）证券交易管理

1、经纪商选择标准
（1）交易执行能力：能够公平对待所有客户，实现最佳价格成交，可靠、诚信、及时成交，具备充分流动性，交易差错少等；
（2）研究支持服务：能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务，包括举办推介会、拜访公司、及时沟通市场情况、承接专项研究、协助交易评价等；
（3）财务实力：净资产、总市值、受托资产等指标处于行业前列，或具有明显的安全边际；
（4）后台便利性和可靠性：交易和清算支持多种方式，软件再开发的能力强，系统稳定安全等；
（5）组织框架和业务构成：具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；
（6）其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、交易量分配

基金管理人将根据上述标准对经纪商进行综合考察，选取最适合基金投资业务的经纪商合作，并根据综合考察结果分配基金在各个经纪商的交易量。

3、佣金管理

基金管理人将根据经纪商提供的服务内容和服务质量，按照最佳市场惯例原则确定佣金费率。交易佣金如有折扣或返还，应归入基金资产。

（十一）基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至2018年3月31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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,513,840,861.63	93.84
	其中：普通股	1,513,840,861.63	93.84
	优先股	－	－
	存托凭证	－	－
	房地产信托凭证	－	－
2	基金投资	－	－
3	固定收益投资	－	－
	其中：债券	－	－
	资产支持证券	－	－
4	金融衍生品投资	－	－
	其中：远期	－	－
	期货	－	－
	期权	－	－
	权证	－	－
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	货币市场工具	－	－
7	银行存款和结算备付金合计	98,543,045.98	6.11
8	其他资产	854,212.34	0.05
9	合计	1,613,238,119.95	100.00

2、报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
香港	1,513,840,861.63	94.97
合计	1,513,840,861.63	94.97

3、报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

（1）报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
电信业务	5,509,026.43	0.35
房地产	229,580,262.77	14.40
非日常生活消费品	201,249,549.88	12.63
工业	197,404,036.23	12.38
公用事业	125,723,015.78	7.89
金融	81,247,397.42	5.10
能源	31,189,329.31	1.96
日常消费品	163,659,903.70	10.27
信息技术	174,974,923.82	10.98
医疗保健	203,975,186.03	12.80
原材料	99,328,230.26	6.23
合计	1,513,840,861.63	94.97

（2）报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资。

4、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及存托凭证投资明细

（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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇光学科技	2382 HK	香港	中国香港	416,900	48,402,559.01	3.04
2	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	石药集团	1093 HK	香港	中国香港	2,716,000	45,373,665.75	2.85
3	CHINA MENGNIU DAIRY CO	蒙牛乳业	2319 HK	香港	中国香港	1,661,000	35,800,571.13	2.25
4	SINO BIOPHARMACEUTICAL	中国生物制药	1177 HK	香港	中国香港	2,771,000	34,192,061.75	2.15
5	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	融创中国	1918 HK	香港	中国香港	1,321,000	32,071,072.88	2.01
6	CHINA GAS HOLDINGS LTD	中国燃气	384 HK	香港	中国香港	1,400,800	32,044,263.05	2.01
7	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	申洲国际	2313 HK	香港	中国香港	405,000	26,820,441.56	1.68
8	CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	华润啤酒	291 HK	香港	中国香港	954,000	25,989,345.00	1.63
9	HENGAN INTL GROUP CO LTD	恒安国际	1044 HK	香港	中国香港	443,500	25,834,263.06	1.62
10	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	华晨中国	1114 HK	香港	中国香港	1,794,000	23,545,308.15	1.48

（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及存托凭证投资明细

报告期末，本基金未持有积极投资。

5、报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

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。

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金融衍生品投资明细

报告期末，本基金未持有金融衍生品。

9、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基金投资明细

报告期末，本基金未持有基金。

10、投资组合报告附注

（1）基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

（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（人民币元）
1	存出保证金	－
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	11,181.88
5	应收申购款	843,030.46
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	854,212.34

（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

本基金本报告期末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

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

七、基金的业绩

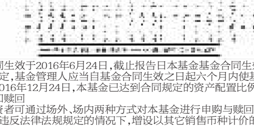
基金业绩截止日为2018年3月31日，所列数据未经审计。

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
2016/06/24－2016/12/31	6.02%	0.83%	12.25%	0.89%	－6.23%	－0.06%
2017/01/01－2017/12/31	34.37%	0.89%	32.66%	0.89%	1.71%	0.00%
2018/01/01－2018/03/31	－0.03%	1.46%	0.31%	1.46%	－0.34%	0.00%
2016/06/24－2018/03/31	42.42%	0.97%	49.36%	0.98%	－6.94%	－0.01%

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：

（2016年6月24日至2018年3月31日）



注：1、本基金基金合同生效于2016年6月24日，截止报告日本基金基金合同生效未满一年。

2、按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至2016年12月24日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

八、基金份额的申购和赎回

基金合同生效后，投资者可通过场外、场内两种方式对本基金进行申购与赎回。

基金管理人可以在不违反法律法规规定的情况下，增设以其它销售币种或计价的基金份额以及接受其它销售币种基金份额的申购、赎回，其他销售币种基金份额申购、赎回的原则、费用等届时由基金管理人确定并提前公告。

（一）申购与赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。

投资者可使用开放式基金账户，通过基金管理人的直销中心和其他场外销售机构，办理本基金的场外申购与赎回业务。

投资者也可使用上海证券账户，通过上海证券交易所系统办理本基金的场内申购与赎回业务。场内申购和赎回业务的场所为具有基金销售业务资格且具有相应业务资格的上海证券交易所会员单位。

具体的基金销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理本基金的申购与赎回。

（二）申购与赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

上海证券交易所、香港交易所同时开放交易的工作日为本基金的开放日，投资者在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。如香港交易所遇节假日、休市或暂停交易，基金管理人将决定本基金是否暂停申购或赎回。

基金合同生效后，若出现新的证券/期货交易市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金自2016年7月6日起开始办理日常申购、赎回业务。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日的基金份额申购、赎回价格。

（三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；
2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；
3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；
4、场外赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资者认购、申购、转托管时基金份额登记的先后次序进行顺序赎回；
5、场内申购与赎回业务遵循上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定。若相关法律法规、中国证监会、上海证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，按新规定执行。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（四）申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资者必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

2、申购和赎回的款项支付

投资者申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资者交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。

投资者赎回申请成功后，基金管理人将在T＋10日(包括该日)内支付赎回款项。如遇外管局相关规定有变更、本基金所投资市场或外汇市场暂停交易、延迟支付赎回款项或交易清算规则发生变更等特殊情况，赎回款项支付时间可相应调整。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资者应在T+2日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资者。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

4、基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并提前公告。

（五）申购与赎回的数量限制

1、申请申购基金的金额

（1）通过基金管理人直销e网金、其他场外销售机构申购本基金时，单笔最低金额为1元人民币（含申购费）。通过基金管理人直销柜台首次申购本基金的最低金额为10万元人民币（含申购费），追加申购最低金额为每笔1元人民币（含申购费）。已在基金管理人直销柜台购买过本基金管理人管理的其他基金的投资者，不受直销柜台首次申购最低金额的限制，但受追加申购最低金额的限制。场外销售机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

（2）投资者通过场内销售机构申购时，单笔申购申请的最低金额为1,000元，且申购申请的金额必须为1元的整数倍。

（3）其他销售机构的投资者欲转入基金管理人直销柜台进行交易，要受直销柜台最低金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整首次申购的最低金额。

（4）投资者可多次申购，对单个投资者累计持有份额不设上限限制。

2、申请赎回基金的份额

投资者可将其全部或部分基金份额赎回。本基金按照份额进行赎回，单笔赎回份额不得低于1份。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构保留的基金份额余额不足1份的，在赎回时必须一次全部赎回。

3、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制，投资者每个基金交易账户的最低基金份额余额限制、单个投资者累计持有的基金份额上限、单个投资者单日或单笔申购金额上限、本基金总规模限额和单日净申购比例上限等。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。

5、对于场内申购、赎回及持有场内份额的数量限制，上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则有规定的，从其最新规定办理。

（六）申购费与赎回费

1、申购费用

本基金采取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，场内申购费率与场外申购费率相同。

申购金额（M）	申购费率
M＜100万元	1.00%
100万元≤M＜200万元	0.60%
M≥200万元	按笔收取，1,000元/笔

申购费用由投资者承担，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用，不列入基金财产。

2、赎回费用

持有基金份额期限（Y）	赎回费率
Y＜7日	1.5%
7日≤Y＜6个月	0.50%
6个月≤Y＜1年	0.25%
Y≥1年	0

注：1年指365日

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。对于收取的持续持有期少于7日的投资人的赎回费，基金管理人将其全额计入基金财产。对于收取的持续持有期大于等于7日的投资人的赎回费，基金管理人将赎回费的25%应当归入基金财产，其余用于支付登记结算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介上公告。

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，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申购费率和赎回费率。

5、办理本基金的场内申购、赎回业务应遵守上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、上海证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

（七）申购份额、赎回金额与基金份额净值的计算

1、申购份额的计算方式

场外、场内申购本基金均采用金额申购的方式，申购金额包括申购费用和净申购金额。

申购费用适用比例费率的情形下：
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/T日基金份额净值

申购费用适用固定金额的情形下：
申购费用=固定金额
净申购金额=申购金额-申购费用
申购份额=净申购金额/T日基金份额净值

场外申购份额计算结果按四舍五入方法，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；场内申购份额计算结果先按四舍五入方法保留到小数点后两位，再按截尾法保留到整数位，小数部分对应的剩余金额由场内销售机构返还投资者。申购费用、净申购金额的计算按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金资产承担。

例：某投资者投资100，000元通过场外申购本基金，对应的申购费率为1.0%，假定申购当日基金份额净值为1.0862元，该投资者可得到的基金份额为：
净申购金额=100，000/（1+1.0%）=99，009.90元
申购费用=100，000–99，009.90=990.10元
申购份额=99，009.90/1.0862=91，152.55份

即投资者投资100，000元通过场外申购本基金，假定申购当日基金份额净值为1.0862元，可得到91，152.55份基金份额。

例：某投资者投资100，000元通过场内申购本基金，对应的申购费率为1.0%，假定申购当日基金份额净值为1.0903元，该投资者可得到的基金份额为：
净申购金额=100，000/（1+1.0%）=99，009.90元
申购费用=100，000–99，009.90=990.10元
申购份额=99，009.90/1.0903=90，809.78份=90，809份
返还给投资者的剩余金额=0.78×1.0903=0.85元

即投资者投资100，000元通过场内申购本基金，假定申购当日基金份额净值为1.0903元，可得到90，809份基金份额，剩余 0.85元返还投资者。

2、赎回金额的计算方式

本基金赎回均采用份额赎回的方式。赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，
赎回总额＝赎回份额×T 日基金份额净值
赎回费用＝赎回总额×赎回费率
赎回金额＝赎回总额－赎回费用

上述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：某投资者通过场外赎回本基金10，000份基金份额，持有时间为一年三个月，对应的赎回费率为0.25%，假设赎回当日基金份额净值是1.1528元，则其可得到的赎回金额为：
赎回总额=10，000×1.1528=11，528 元
赎回费用=11，528×0.25%=28.82元
赎回金额=11，528-28.82=11，499.18 元

即投资者赎回本基金10，000份基金份额，持有期限为一年三个月，假设赎回当日基金份额净值是1.1528元，则其可得到的赎回金额为11，499.18元。

3、基金份额净值的计算精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。基金份额净值应当在估值日后2个工作日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

（八）申购与赎回的登记

1、投资者T 日场外申购成功后，正常情况下，登记机构在T＋1日为投资者增加权益并办理登记手续，投资者自T＋2日起有权赎回该部分基金份额。

2、投资者T日场外赎回成功后，正常情况下，登记机构在T＋1日为投资者扣除权益并办理相应的登记手续。

3、本基金场内申购和赎回的登记业务，按照上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定处理。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

（九）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请：
1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资者的申购申请。当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。
3、本基金投资所处的证券/期货交易所或外汇市场交易时间非正常停市，可能影响本基金投资，或导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
4、指数编制单位或指数发布机构因异常情况使指数数据无法正常计算、计算错误或发布异常时。
5、基金管理人接受某笔或某些申购申请会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
6、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或出现其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
7、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。
8、基金管理人管理的境外证券投资基金的资产规模达到监管机构核定的本基金管理人境外证券投资额度。
9、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额数的比例达到或者超过基金份额总数的50%，或者变相规避50%集中度的情形时。
10、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。
11、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1-4、6-8、11项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

（十）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：
1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。
2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项。当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项。
3、基金投资所处的证券/期货交易所或外汇市场正常或非正常停市，可能影响本基金投资，或导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请。
6、指数编制单位或指数发布机构因异常情况使指数数据无法正常计算、计算错误或发布异常时；
7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，对于场外赎回申请，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，场内赎回申请按照上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则办理。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

（十一）巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(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)超过前一开放日的基金总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

（1）巨额赎回的场外处理

当出现巨额赎回时，对于场外赎回申请，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为因支付投资者的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。在单个基金份额持有人超过基金总份额20%以上的赎回申请情形下，本基金有权按照以下规则实施延期办理赎回申请：若发生巨额赎回，存在单个基金份额持有人超过基金总份额20%以上（“大额赎回申请人”）的赎回申请情形，基金管理人可以按照保护其他赎回申请人（“普通赎回申请人”）利益的原则，优先确认普通赎回申请人的赎回申请，在当日可接受赎回的范围内对普通赎回申请人的赎回申请予以全部确认或按单个账户赎回申请量占普通赎回申请人赎回申请总量的比例确认；在普通赎回申请人的赎回申请全部确认且当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下，在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例确认。

对于未能受理部分，投资者在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

3）暂停赎回：连续2个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

（2）巨额赎回的场内处理

巨额赎回的场内处理，按照上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。

（十二）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内在指定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个开放日的基金份额净值。如发生暂停的时间超过1日，基金管理人可以按照《信息披露办法》的有关规定自行确定在指定媒介上刊登基金暂停公告的次数，并应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个估值日的基金份额净值。

（十三）基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

（十四）基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资者。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

（十五）基金份额的登记和转托管

1、基金份额的登记

（1）本基金的基金份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的基金份额，登记在登记结算系统中基金份额持有人的开放式基金账户下；场内认购、申购、上市交易买入或通过跨系统转托管从场外转到场内的基金份额，登记在证券登记系统基金份额持有人上海证券账户下。

（2）登记在证券登记系统中的基金份额，可以直接申请场内赎回，也可在上海证券交易所上市交易。

（3）登记在登记结算系统中的基金份额，可以直接申请场外赎回，也可以办理跨系统转托管至证券登记系统后，在上海证券交易所上市交易。

2、基金份额的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。本基金的转托管包括系统内转托管和跨系统转托管。

（1）系统内转托管

1）系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间进行转托管或在证券登记系统内不同会员单位（交易单元）之间进行指定关系变更的行为。

2）基金份额登记在登记结算系统的基金份额持有人在变更办理基金份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

3）募集期间内不得办理系统内转托管。

（2）跨系统转托管

1）跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管的行为。

2）基金份额跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司及上海证券交易所的相关规定办理。

（3）基金销售机构可以按照相关规定向基金份额持有人收取转托管费。

（4）本基金上市前、权益分派期间、上海证券交易所规定相应停牌日期、基金份额处于质押、冻结状态或出现上海证券交易所、登记机构规定的其他情形时，不得办理跨系统转托管。

（十六）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资者在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

（十七）基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

（十八）基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

（十九）其他业务

在不违反法律法规及中国证监会规定的前提下，基金管理人可在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下，办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人可制定相应的业务规则，并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。

九、基金的费用与税收

（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，含境外托管代理行收取的费用；
3、标的指数使用相关费用；
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费、律师费、税务顾问费、仲裁费和诉讼费；
6、基金份额持有人大会费用；
7、基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于在境外市场开户、交易、清算、登记、存管等各项费用）；
8、基金的银行汇划费用和外汇兑换交易的相关费用；
9、基金依照有关法律法规应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息、罚金及费用）以及相关手续费、汇款费、基金的税务代理费；
10、基金的开户费用、账户维护费用；
11、除基金管理人和基金托管人因自身原因而导致的更换基金管理人、更换基金托管人及基金资产由原任基金托管人转移至新任基金托管人以及由于境外托管人更换导致基金资产转移所引起的费用；
12、为应付赎回和交易清算而进行临时借款所发生的费用；
13、基金的上市费用；
14、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。

（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1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H＝E×1.00%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。境外托管人的托管费从基金托管人的托管费中扣除。托管费的计算方法如下：
H＝E×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

3、标的指数使用相关费用

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数许可使用协议的约定计提标的指数使用相关费用，基金合同生效后的标的指数使用相关费用从基金财产中列支。本基金的标的指数使用相关费用包括标的指数许可使用费和标的指数数据使用费。

（1）标的指数许可使用费

标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。计算方法如下：
H=E×0.05%÷当年天数
H为每日应计提的指数许可使用费
E为前一日的基金资产净值

若任一年度累计计提指数许可使用费金额按年度最后一日（如为节假日取最近一日）中国人民银行或其授权机构公布的汇率中间价折算的金额小于指数许可使用协议规定的年度费用下限，则基金于该年度最后一日补提标的指数许可使用费至指数使用许可协议规定的费用收取下限，本基金标的指数许可使用费的收取下限为每年30，000美元。

（2）标的指数数据使用费

标的指数数据使用费每日计提，每年8，000美元。计算方法如下：
H=8，000×中国人民银行公布的人民币兑美元汇率中间价÷当年天数
H为每日应计提的指数数据使用费

标的指数数据使用费每日以人民币计提，按年度支付。若由于汇率影响当年计提的标的指数数据使用费高于或低于8，000美元，则基金与该年度最后一日调整计提的数据使用费至8，000美元。

经基金管理人和基金托管人核对一致后，基金托管人按照基金管理人发送的标的指数许可使用费和标的指数数据使用划付指令，基金托管人于次年首日起15日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据指数许可使用协议所规定的方式支付给标的指数许可方。

如果指数许可使用协议约定的指数许可使用费和指数数据使用费的计算方法、费率和支付方式发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费和指数数据使用费。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒介进行公告，此项调整无须召开基金份额持有人大会。

上述“（一）基金费用的种类中第4－14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；
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

基金根据国家法律法规和基金投资所在地的法律法规规定，履行纳税义务。基金管理人对最终税务的处理的真实准确负责。

基金份额持有人根据中国法律法规规定，履行纳税义务。

除因基金管理人或基金托管人疏忽、故意行为导致的基金在税收方面造成的损失外，基金管理人和基金托管人不承担责任。

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规和境外市场的规定执行。

十、《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》)、《公开募集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，华宝基金管理有限公司对《华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）招募说明书》作如下更新：

1、根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》更新了相关内容。
2、“四、基金的投资”更新了本基金截至2018年3月31日的投资组合数据。
3、“五、基金的业绩”更新了本基金截至2018年3月31日的业绩数据。
4、“六、基金管理人”更新了本基金管理人的相关信息。
5、“二十、相关服务机构”更新了本基金代销机构的相关信息。
6、“二十四、其他应披露事项”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，须与本基金《招募说明书》后面所载之详细资料一并阅读。

华宝基金管理有限公司
2018年8月4日