华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）摘要

2018年第2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2015年5月21日中国证券监督管理委员会《关于准予华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金（LOF）注册的批复》（证监许可[2015]955号）和2016年1月20日《关于华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金（LOF）延期募集备案的回函》（机构部函[2016]126号）进行募集。

基金管理人保证《华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金(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。

本基金主要投资于美国证券市场，基金净值会因为美国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基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数基金，主要采用完全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9月18日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2018年6月30日，财务数据未经审计。

一、基金合同生效日

本基金基金合同生效日：2016年3月18日

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（黄小薏）
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。

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：博士。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月任华宝兴业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。目前兼任华宝资产管理（香港）有限公司董事。

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、华宝绿色主题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》、《中国人民共和国证券法》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、基金管理人不得有下列行为：
（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）不泄露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。本基金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。

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)。

2018年6月末，本集团资产总额228,051.82亿元，较上年末增加6,807.99亿元，增幅3.08%。上半年，本集团盈利平稳增长，利润总额较上年同期增加93.27亿元至1,814.20亿元，增幅5.42%；净利润较上年同期增加84.56亿元至1,474.65亿元，增幅6.08%。

2017年，本集团先后荣获香港《亚洲货币》"2017年中国最佳银行"，美国《环球金融》"2017最佳转型银行"、新加坡《亚洲银行家》"2017年中国最佳数字银行"、"2017年中国最佳大型零售银行奖"，《银行家》"2017最佳金融创新奖"及中国银行业协会"年度最具社会责任金融机构"等多项重要奖项。本集团在英国《银行家》"2017全球银行1000强"中列第2位；在美国《财富》"2017年世界500强排行榜"中列第28名。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、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，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工315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，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），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。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），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。

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。

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2018年二季度末，中国建设银行已托管857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。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》"中国最佳托管银行"、4次获得《财资》"中国最佳次托管银行"、连续5年获得中债登"优秀资产托管机构"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"、在2017年荣获《亚洲银行家》"最佳托管系统实施奖"。

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.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，如有必要将及时报告中国证监会。

四、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1.场外发售机构

（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
邮编：100818
法定代表人：陈四清
联系人：陈洪源
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
邮编：100033
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：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
邮编：200120
法定代表人：彭纯
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
邮编：518040
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：广东省深圳市深南东路5047号
邮编：518001
法定代表人：谢永林
联系人：戴青
客户电话：95511-3
公司网址：www.bank.pingan.com

（6）上海浦东发展银行股份有限公司
办公地址：上海市中山东一路12号
邮编：200002
法定代表人：高国富
联系人：胡子豪
传真：021-61162165
客户电话：95528
公司网址：www.spdb.com.cn

（7）深圳前海微众银行股份有限公司
办公地址：广东省深圳市南山区沙河西路1819号深圳湾科技生态园7栋A座
法定代表人：顾敏
客户电话：400-999-8800
公司网址：www.webank.com

（8）北京汇成基金销售有限公司
联系电话：400-619-9059

（9）上海万得基金销售有限公司
联系电话：400-821-0203

（10）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
邮编：518026
法定代表人：王连志
联系人：陈剑虹
客户电话：95517
公司网址：www.essence.com.cn

（11）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（奥体中心北侧）
法定代表人：王春峰
联系人：王星
传真：022-28451958
客户电话：400-651-5988
公司网址：www.ewww.com.cn

（12）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
法定代表人：沈继宁
联系人：陶志华
客户电话：95336，4008696336
公司网址：www.ctsec.com

（13）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
邮编：518034
法定代表人：丁益
联系人：金夏
客户电话：400-6666-888
公司网址：www.cgws.com

（14）长江证券股份有限公司
办公地址：湖北省武汉市江汉区新华路特8号
邮编：430015
法定代表人：尤习贵
联系人：奚博宇
联系电话：027-65799999
传真：027-85481900
客户电话：95579
公司网址：www.95579.com

（15）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

（16）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
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/

（17）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
法定代表人：武晓春
联系人：刘熠
联系电话：95353
传真：862168767981
客户电话：400-8888-128
公司网址：www.tebon.com.cn

（18）第一创业证券股份有限公司
办公地址：深圳市福田中心区福华一路115号投行大厦18F
邮编：518000
法定代表人：刘学民
联系人：李晓伟
传真：0755-25838701
客户电话：95358
公司网址：www.firstcapital.com.cn/

（19）东北证券股份有限公司
办公地址：长春市生态大街6666号
邮编：130118
法定代表人：李福春
联系人：安岩岩
联系电话：400-600-0686
传真：0431-85096795
客户电话：95360
公司网址：www.nesc.cn

（20）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
邮编：200010
法定代表人：潘鑫军
联系人：王欣
联系电话：95503
传真：021-63326729
客户电话：95503
公司网址：www.dfzq.com.cn

（21）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
法定代表人：赵俊
联系人：王一彦
联系电话：95531
传真：021-50498825
客户电话：95531；400-8888-588
公司网址：www.longone.com.cn

（22）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
邮编：215021
法定代表人：范力
联系人：陆晓
传真：0512-62938527
客户电话：95330
公司网址：www.dwzq.com.cn

（23）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
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

（24）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
法定代表人：周健男
联系人：李晓皙
传真：021-22169134
客户电话：95525
公司网址：www.ebscn.com

（25）广发证券股份有限公司
办公地址：广东省广州市天河北路183号大都会广场43楼
法定代表人：孙树明
联系人：马梦洁
客户电话：95575
公司网址：www.gf.com.cn

（26）国都证券股份有限公司
办公地址：北京市东城区东直门内大街3号国华投资大厦9层
邮编：100007
法定代表人：王少华
联系人：李弢
传真：010-84183311
客户电话：400-818-8118
公司网址：www.guodu.com

（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
邮编：214121
法定代表人：姚志勇
联系人：祁昊
传真：0510-82830162
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
法定代表人：杨德红
联系人：钟伟镇
联系电话：400-888-6628
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
法定代表人：何如
联系人：周杨
联系电话：95536
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
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）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

（32）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

（33）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
邮编：230081
法定代表人：章宏韬
联系人：范超
传真：0551-65161672
客户电话：95318
公司网址：www.hazq.com

（34）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
邮编：200120
法定代表人：陈林
联系电话：400-820-9898
传真：021-68777822
客户电话：400-820-9898
公司网址：www.cnhbstock.com

（35）华福证券有限责任公司
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1088号招商银行上海大厦18-19层
法定代表人：黄金琳
联系人：王虹
传真：021-20655196
客户电话：95547
公司网址：www.hfzq.com.cn

（36）华泰证券股份有限公司
办公地址：南京市江东中路288号华泰证券一号楼
邮编：210019
法定代表人：周易
联系人：马艺卿
传真：021-83387254
客户电话：95597
公司网址：www.htsc.com.cn

（37）上海华夏财富投资管理有限公司
客户电话：400-817-5666

（38）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
法定代表人：王翔
客户电话：400-820-5369
公司网址：www.jiyufund.com.cn

（39）江海证券有限公司
办公地址：哈尔滨市松北区创新三路833号
邮编：150028
法定代表人：赵宏波
联系人：姜志伟
传真：0451-82337279
客户电话：400-666-2288
公司网址：www.jhzq.com.cn

（40）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

（41）北京肯特瑞基金销售有限公司
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

（42）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

（43）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
公司网址：http://www.fund123.cn/

（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
法定代表人：何之江
联系人：周驰
联系电话：95511
传真：0755-82435367
客户电话：95511-8
公司网址：www.stock.pingan.com

（45）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
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

（46）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40楼
邮编：200031
法定代表人：李梅
联系人：陈飙
联系电话：95523
传真：021-33388224
客户电话：95523
公司网址：www.swhysc.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40楼
邮编：200031
法定代表人：李梅
联系人：陈飙
联系电话：95523
传真：021-33388224
客户电话：95523
公司网址：www.swhysc.com

（48）南京苏宁基金销售有限公司
客户电话：95177
公司网址：www.snjijin.com

（49）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

（50）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

（51）上海挖财金融信息服务有限公司
客户电话：021-50810673
公司网址：www.wacaijijin.com

（52）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
邮编：400023
法定代表人：廖庆轩
联系人：周青
传真：023-63786212
客户电话：4008-096-096
公司网址：www.swsc.com.cn

（53）信达证券股份有限公司
办公地址：北京市西城区宣武门西大街甲127号大成大厦6层
法定代表人：张志刚
联系人：张晓辰
传真：010-63081344
客户电话：95321
公司网址：www.cindasc.com

（54）兴业证券股份有限公司
办公地址：上海市浦东新区长柳路36号
法定代表人：杨华辉
联系人：（公邮）
客户电话：95562
公司网址：www.xyzq.com.cn

（55）奕丰金融服务（深圳）有限公司
客户电话：400-684-0500
公司网址：www.ifastps.com.cn

（56）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
邮编：100033
法定代表人：陈共炎
联系人：辛国政
联系电话：95551
传真：010-83574807
客户电话：4008-888-888或95551
公司网址：www.chinastock.com.cn

（57）招商证券股份有限公司
办公地址：深圳福田区益田路江苏大厦A座30楼
法定代表人：霍达
联系人：黄婵君
联系电话：95565
传真：0755-82943227
客户电话：95565
公司网址：www.newone.com.cn

（58）中航证券有限公司
办公地址：北京市朝阳区望京东园四区2号中航资本大厦35层
邮编：100102
法定代表人：王晓峰
联系人：王紫雯
传真：010-59562637
客户电话：400-8866-567
公司网址：www.avicsec.com

（59）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
法定代表人：毕明建
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

（60）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
法定代表人：李玮
联系人：秦雨晴
传真：021-20315125
客户电话：95538
公司网址：www.zts.com.cn

（61）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
法定代表人：高涛
联系人：胡芷境
联系电话：95532
传真：0755-82026539
客户电话：95532或400-600-8008
公司网址：www.china-invs.cn

（62）中信建投证券股份有限公司
办公地址：北京东城区朝内大街2号凯恒中心B座18层
法定代表人：王常青
联系人：许梦园
联系电话：400-888-8108
客户电话：95587
公司网址：www.csc108.com

（63）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
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

（64）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
邮编：100026
法定代表人：张佑君
联系人：王一通
联系电话：400-889-5548
传真：010-60833739
客户电话：95548
公司网址：www.cs.ecitic.com

（65）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
邮编：100026
法定代表人：张佑君
联系人：王一通
联系电话：400-889-5548
传真：010-60833739
客户电话：95548
公司网址：www.cs.ecitic.com

（66）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
客户电话：400-678-8887
公司网址：www.zlfund.cn

（67）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

2、场内发售机构

本基金场内将通过深圳证券交易所内具有基金销售业务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会员单位发售。本基金认购期结束前获得基金销售业务资格的证券公司也可代理场内基金份额的发售。尚未取得基金销售业务资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可在本基金份额上市后，通过深圳证券交易所交易系统办理本基金份额的上市交易。

（二）登记机构

本基金人民币份额的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，美元份额的登记机构为华宝基金管理有限公司。

1、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

2、名称：华宝基金管理有限公司
注册地址：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
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
电话：021－38505888
传真：021－38505777
联系人：章希

（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：孙睿
经办律师：黎明、孙睿

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址：上海市延安东路222号外滩中心30楼
办公地址：上海市延安东路222号外滩中心30楼
负责人：曾顺福
联系电话：021-61418888
传真：021-63350177
联系人：曾浩
经办注册会计师：曾浩、吴凌志

五、基金的名称

本基金名称：华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金（LOF）

六、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

七、基金的投资目标

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%。

八、基金的投资范围

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、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的公募基金(包括ETF)、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投资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)。

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%，投资于跟踪同一标的指数的公募基金(包括ETF)的比例不超过基金资产净值的10%。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%。

九、基金的投资策略

本基金原则上采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如股票停牌、流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将使用其他合理方法进行适当的替代，追求尽可能贴近目标指数的表现。

本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标的指数相关的公募基金（包括ETF），以优化投资组合的建立，达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。

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。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，适当开展证券借贷业务，以期降低跟踪误差水平。

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股指期货等金融衍生品，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。

十、基金的业绩比较基准

本基金的标的指数为标普美国品质消费股票指数（S&P Consumer Discretionary Select Sector Index）。

本基金的业绩比较基准为经人民币汇率调整的标普美国品质消费股票指数收益率×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。

十一、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数基金，主要采用完全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。

十二、基金的投资组合报告

本基金的投资组合报告所载的数据截至2018年6月30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	223,610,547.36	91.31
	其中：普通股	223,610,547.36	91.31
	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	17,513,558.04	7.15
8	其他资产	3,763,443.76	1.54
9	合计	244,887,549.16	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（%）
美国	223,610,547.36	94.09
合计	223,610,547.36	94.09

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（%）
能源	-	-
材料	-	-
工业	-	-
非日常生活消费品	223,610,547.36	94.09
日常消费品	-	-
保健	-	-
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
合计	223,610,547.36	94.09

（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	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克	美国	4,573	51,432,058.52	21.64
2	HOME DEPOT INC	家得宝	HD US	纽约	美国	13,100	16,910,772.45	7.12
3	NETFLIX INC	奈飞公司	NFLX US	纳斯达克	美国	4,936	12,783,922.80	5.38
4	WALT DISNEY CO/THE	华特迪士尼	DIS US	纽约	美国	16,884	11,708,815.02	4.93
5	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特	CMC-SA US	纳斯达克	美国	52,151	11,321,494.28	4.76
6	MCDONALDS CORP	麦当劳	MCD US	纽约	美国	8,916	9,243,708.06	3.89
7	NIKE INC-CL B	耐克公司	NKE US	纽约	美国	14,567	7,679,878.09	3.23
8	BOOKING HOLDINGS INC	Booking控股股份有限公司	BKNG US	纳斯达克	美国	547	7,336,606.70	3.09
9	LOWES COS INC	劳氏	LOW US	纽约	美国	9,335	5,902,972.89	2.48
10	STARBUCKS CORP	星巴克	SBUX US	纳斯达克	美国	15,672	5,065,518.10	2.13

（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

本基金本报告期末未持有积极投资。

5、报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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

本基金本报告期末未持有基金。

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	63,160.28
4	应收利息	1,117.75
5	应收申购款	3,699,165.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,763,443.76

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

本基金本报告期末未持有积极投资。

十三、基金的业绩

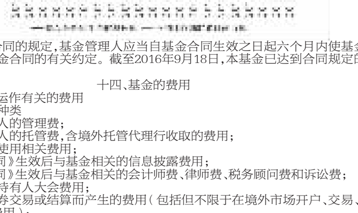
基金业绩截止日为2018年6月30日，所列数据未经审计。

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
2016/03/18-2016/12/31	10.10%	0.71%	10.99%	0.74%	-0.89%	-0.03%
2017/01/01-2017/12/31	12.90%	0.54%	13.47%	0.54%	-0.57%	0.00%
2018/01/01-2018/06/30	11.58%	1.06%	11.61%	1.06%	-0.03%	0.00%
2016/03/18-2018/06/30	38.70%	0.74%	40.57%	0.75%	-1.87%	-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：

华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金（LOF）
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
（2016年3月18日至2018年6月30日）



注：按照基金合同的规定，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9月18日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

十四、基金的费用

（一）与基金运作有关的费用

1、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。

2、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，自动在次月初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、公休假等，支付日期顺延。

（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，自动在次月初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、公休假等，支付日期顺延。

（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6,000美元。计算方法如下：

H=6,000×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6,000美元，则基金与该年度最后一日调整计提的数据使用费至6,000美元。

经基金管理人和基金托管人核对一致后，由基金管理人向基金托管人发送标的指数许可使用费和标的指数数据使用费划付指令，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"1、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。

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调低基金管理费率和基金托管费率。基金管理人应按照《信息披露办法》的规定在指定媒介上公告。

3、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。

4、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性确负责。

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。

（二）与基金有关的销售费用

1、申购费用

投资者在一天之内如有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

（1）人民币份额申购费用

本基金人民币份额的场外申购费率如下，场内申购费率由场内销售机构参照场外申购费率执行。

申购金额（M）（人民币）	申购费率
M＜100万元	1.20%
100万元≤M＜200万元	0.80%
200万元≤M＜500万元	0.40%
M≥500万元	按笔收取，1000元/笔

（2）美元份额申购费用

本基金美元份额的场外申购费率如下。

申购金额（M）（美元）	申购费率
M＜10万美元	1.20%
10万美元≤M＜30万美元	0.80%
30万美元≤M＜60万美元	0.40%
M≥60万美元	按笔收取，200美元/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

本基金人民币份额的场内赎回费率为0.5%。本基金人民币份额和美元份额的场外赎回费率表如下：

持有基金份额期限（Y）	赎回费率
Y＜7日	1.5%
7日≤Y＜1年	0.50%
1年≤Y＜2年	0.25%
Y≥2年	0

注：1年指365日，2年为730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。对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产。对持续持有期大于或等于7日的投资者收取的赎回费，不低于赎回费总额的25%计入基金财产，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、办理人民币份额的场内申购、赎回业务应遵守深圳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、深圳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。

5、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

1）申购人民币份额的计算方式

场外、场内申购本基金人民币份额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＋人民币份额申购费率）
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

场外申购人民币份额的计算按四舍五入方法，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；场内申购人民币份额的计算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1：某投资者投资100,000元通过场外申购本基金人民币份额，对应的申购费率为1.2%，假定申购当日人民币份额净值为1.086元，该投资者可得到的基金份额为：

净申购金额=100,000/（1+1.2%）＝98,814.23元
申购费用=100,000-98,814.23＝1,185.77元
申购份额=98,814.23/1.086＝90,989.16份

即：投资者投资100,000元通过场外申购本基金人民币份额，假定申购当日人民币份额净值为1.086元，可得到90,989.16份人民币份额。

例2：某投资者投资100,000元通过场内申购本基金人民币份额，对应的申购费率为1.2%，假定申购当日人民币份额净值为1.090元，该投资者可得到的基金份额为：

净申购金额=100,000/（1+1.2%）＝98,814.23元
申购费用=100,000-98,814.23＝1,185.77元
申购份额=98,814.23/1.090＝90,655.26份=90,655份
返还给投资者的剩余金额=0.26×1.090=0.28元

即：投资者投资100,000元通过场内申购本基金人民币份额，假定申购当日人民币份额净值为1.090元，可得到90,655份基金份额，剩余 0.28元返还投资者。

2）申购美元份额的计算方式

申购本基金美元份额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＋美元份额申购费率）
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

例：某投资者投资10,000美元申购本基金美元份额，对应的申购费率为1.2%，假定申购当日美元份额净值为0.183美元，该投资者可得到的基金份额为：

净申购金额=10,000/（1+1.2%）＝9,881.42美元
申购费用=10,000－9,881.42＝119.58美元
申购份额=9,881.42/0.183＝53,996.83份

即：投资者投资10,000美元申购本基金美元份额，假定申购当日美元份额净值为0.183美元，可得到53,996.83份美元份额。

（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份人民币份额，持有时间为一年三个月，对应的赎回费率为0.25%，假设赎回当日人民币份额净值是1.152元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=10,000×1.152=11,520 元
赎回费用=11,520×0.25%=28.80元
赎回金额=11,520-28.80=11,491.20 元

即：投资者通过场外赎回本基金10,000份人民币份额，持有期限为一年三个月，假设赎回当日人民币份额净值是1.152元，则其可得到的赎回金额为11,491.20元。

例：某投资者通过场内赎回本基金10,000份人民币份额，对应的赎回费率为0.5%，假设赎回当日人民币份额净值是1.150元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=10,000×1.150=11,500元
赎回费用=11,500×0.5%=57.50元
赎回金额=11,500-57.50=11,442.50元

即：投资者通过场内赎回本基金10,000份人民币份额，假设赎回当日人民币份额净值是1.150元，则其可得到的赎回金额为11,442.50元。

（3）本基金分别计算人民币份额和美元份额的基金份额净值。人民币份额净值的计算精确到0.001元，小数点后第四位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担；美元份额净值的计算精确到0.0001美元，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。

十五、《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《华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金（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6月30日的基金投资组合报告。
3、"五、基金的业绩"更新了本基金截至2018年6月30日的基金业绩数据。
4、"六、基金管理人"更新了基金管理人的相关信息。
5、"十八、基金托管人"更新了基金托管人的相关信息。
6、"十九、境外托管人"更新了境外托管人的相关信息。
7、"二十、相关服务机构"更新了本基金代销机构的相关信息。
8、"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10月31日

关于华宝基金公司旗下部分产品增加南京银行为代销机构的公告

根据华宝基金管理有限公司（以下简称"本公司"）与南京银行股份有限公司（以下简称"南京银行"）签署的《证券投资基金销售代理协议》，本公司自2018年10月31日起增加南京银行为华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金（基金代码：A:000753，C:000754）、华宝现金宝货币市场基金（基金代码：A:240006，B:240007）的代销机构。投资者可到南京银行各网点办理华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝现金宝货币市场基金的开户、申购、赎回、定期定额投资及其他相关业务。

投资者可以通过以下途径咨询有关情况：

1.南京银行股份有限公司
客户服务热线：95302
公司网址：www.njcb.com.cn

2.华宝基金管理有限公司
客户服务电话：400-700-5588，021-38924558
网站：www.fsfund.com

风险提示：本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资基金时应认真阅读基金的基金合同、招募说明书。敬请投资者留意投资风险。

华宝基金管理有限公司
2018年10月31日

华宝中证1000指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

根据《华宝中证1000指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称"基金合同"）中关于不定期份额折算的相关规定，当华宝中证1000B份额的基金份额参考净值跌至0.2500元或以下时，本基金将分别对华宝中证1000份额（场内简称：1000分级，代码：162413）、华宝中证1000A份额（场内简称：1000A，代码：150263）、华宝中证1000B份额（场内简称：1000B，代码：150264）进行不定期份额折算。

由于近期A股市场波动较大，截至2018年10月30日，华宝中证1000B份额的基金份额参考净值接近基金合同规定的不定期份额折算条件，因此提请投资者密切关注华宝中证1000B份额近期的基金份额参考净值波动情况，并警惕可能出现的风险。

针对前述情形下的不定期折算所带来的风险，本基金管理人特别提示如下：

1、触发不定期折算当日，华宝中证1000B份额的基金份额参考净值已跌至0.2500元或以下，而折算基准日在触发日后才能确定，因此折算基准日华宝中证1000B份额的基金份额参考净值可能与0.2500元有差异。

2、由于华宝中证1000A、华宝中证1000B份额折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，华宝中证1000A、华宝中证1000B份额的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价所带来的风险。

3、华宝中证1000B份额具有预期风险、预期收益较高的特征。随着华宝中证1000B份额的基金份额参考净值降低，其杠杆率升高。在不定期份额折算后，华宝中证1000B份额的杠杆率将恢复至初始杠杆水平。

4、华宝中证1000A份额具有预期风险、预期收益较低的特征。但在发生不定期份额折算后，华宝中证1000A份额的持有人会获得一定比例的华宝中证1000份额，原华宝中证1000A份额持有人的风险收益特征将发生一定变化，由持有单一的较低风险收益特征的华宝中证1000A份额变为同时持有较低风险收益特征的华宝中证1000A份额与较高风险收益特征的华宝中证1000份额，因此原华宝中证1000A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。此外，华宝中证1000份额为跟踪指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原华宝中证1000A份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

5、根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司和基金管理人的相关业务规则，场外份额进行份额折算时计算结果保留到小数点后2位，小数点后2位以后的部分舍去，舍去部分计入基金财产。场内份额进行份额折算时计算结果保留至整数位（最小单位为1份），小数点以后的部分舍去，舍去部分计入基金财产。因此，在不定期份额折算过程中，由于尾差处理，可能使持有人的资产净值出现微小误差，但视为未改变基金份额持有人的资产净值。

6、在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资格，而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司赎回基金份额。因此，如果投资者通过不具备基金销售资格的证券公司购买华宝中证1000A份额，在不定期份额折算后，则折算新增的华宝中证1000份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将华宝中证1000A份额卖出，或者在折算后将新增的华宝中证1000份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

本基金管理人的其他重要提示：

1、为保证折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停华宝中证1000A份额与华宝中证1000B份额的上市交易和华宝中证1000份额的申购、赎回、配对转换等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告，敬请投资者予以关注。

2、投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅本基金的基金合同及《华宝中证1000指数分级证券投资基金招募说明书》(以下简称"招募说明书")或者拨打本公司客服电话：400-700-5588（免长途话费），021-38924558。

3、本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。投资有风险，选择须谨慎。敬请投资者于投资前认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件和临时公告。

特此公告。

华宝基金管理有限公司
2018年10月31日