华宝上证180价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金（更新）招募说明书摘要

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。基金合同于2010年4月23日正式生效。

基金管理人保证《华宝上证180价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》(以下简称"招募说明书"或"本招募说明书")的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

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:因整体政治、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,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特定风险等等。

本基金是上证180价值ETF的联接基金,主要通过投资于上证180价值ETF以求达到投资目标,两者的标的指数一致,投资目标相似。

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。

本摘要根据《基金合同》和《招募说明书》编写,经基金托管人审核,并经中国证监会核准。《基金合同》是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。投资人自取得依《基金合同》所发售的基金份额,即成为基金份额持有人和《基金合同》当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对《基金合同》的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定享有权利、承担义务;基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅《基金合同》。

本招募说明书所载内容截止日为2018年10月23日,有关财务数据和净值表现截止日为2018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（黄小意）
成立日期:2003年3月7日
注册资本:1.5亿元
电话:021-38505888
联系人:章希
股权结构:中方股东华宝信托有限责任公司持有51%的股份,外方股东领先资产管理有限公司持有49%的股份。

（二）基金管理人主要人员情况

1、董事会成员

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,中国宝武钢铁集团有限公司产业金融党工委副书记、纪委书记,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（黄小意）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、华宝投资有限公司工作,现任华宝信托有限责任公司风险管理部副总经理。

贺桂先先生,监事,本科。曾任华宝信托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、高级管理人员

孔祥清先生,董事长,简历同上。

HUANG Xiaoyi Helen（黄小意）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、董事会秘书,宝钢金融系统党委组织部部长、党委办公室主任。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

丰晨成,硕士。2009年加入华宝基金管理有限公司,先后担任助理产品经理、数量分析师、投资经理助理、投资经理等职务。2015年11月起任上证180价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证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月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2018年4月起任华宝中证500指数增强型发起式证券投资基金基金经理,2018年6月起任华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理,2018年8月起任华宝中证1000指数分级证券投资基金基金经理。

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:1984年1月1日
法定代表人:易会满
注册资本:人民币35,640,625.71万元
联系电话:010-66105799
联系人:郭明

（二）主要人员情况

截至2018年6月,中国工商银行资产托管部共有员工212人,平均年龄33岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,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业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII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2017年6月,中国工商银行共托管证券投资基金745只。自2003年以来,本行连续十四年获得香港《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》等境内外权威财经媒体评选的54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）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来,各项业务飞速发展,始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得,是与资产托管部"一手抓业务拓展,一手抓内控建设"的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作,在积极拓展各项托管业务的同时,把加强风险防范和控制的力度,精心培育内控文化,完善风险控制机制,强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014、2015、2016、2017共十一次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的ISAE3402审阅,获得无保留意见的控制及有效性报告,表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可,也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨,达到国际先进水平。目前,ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格,形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系;防范和化解经营风险,保证托管资产的安全完整;维护持有人的权益;保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策,对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律规章,对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求,并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约;监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节,覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录;按照"内控优先"的原则,新设机构或新增业务品种时,必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险,审慎经营,保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善,并保证得到全面落实执行,不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门;直接操作人员和控制人员必须相对独立,适当分离;内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离,建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度,并采取了良好的防火墙隔离制度,能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

（2）高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者,要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况,以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展,并根据检查情况提出内部控制措施,督促职能管理部门改进。

（3）人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制,建立"自控防线"、"互控防线"、"监控防线"三道控制防线,健全绩效考核和激励机制,树立"以人为本"的内控文化,增强员工的责任心和荣誉感,培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书,使员工树立风险防范与控制理念。

（4）经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务,从而有效地控制和配置组织资源,达到资源利用和效益最大化目的。

（5）内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理,定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控,指导业务部门进行风险识别、评估,制定并实施风险控制措施,排查风险隐患。

（6）数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

（7）应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心,制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案,并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战,资产托管部不断提高演练标准,从最初的按照预订时间演练发展到现在的"随机演练"。从演练结果看,资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况

（1）资产托管部内部设置专职稽核监察部门,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律规章,全面贯彻落实全程监控思想,确保资产托管业务健康、稳定地发展。

（2）完善组织结构,实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与,只有这样,风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理,将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位,每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责,通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构,形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

（3）建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设,一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力,资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度,包括:岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等,覆盖所有部门和岗位,渗透各项业务过程,形成各个业务环节之间的相互制约机制。

（4）内部风险控制始终是托管部工作重点之一,保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务,资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作,一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展,新问题、新情况不断出现,资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置,视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

（五）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

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定,基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查,其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对,并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。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,基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

四、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

（1）直销柜台

本公司在上海开设直销柜台。
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

（2）直销e网金

投资者可以通过本公司网上交易直销e网金系统办理本基金的申购、赎回、转换等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上交易网址:www.fsfund.com。

2、代销机构

（1）中国工商银行股份有限公司
办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号
邮编:100140
法定代表人:易会满
联系电话:95588
客户电话:95588;010-66106114
公司网址:www.icbc.com.cn

（2）中国农业银行股份有限公司
办公地址:北京市东城区建国门内大街69号
邮编:100005
法定代表人:周慕冰
联系电话:95599
客户电话:95599
公司网址:www.abchina.com

（3）中国银行股份有限公司
办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号中国银行总行办公大楼
邮编:100818
法定代表人:陈四清
联系人:陈洪源
联系电话:95566
客户电话:95566
公司网址:www.boc.cn

（4）中国建设银行股份有限公司
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮编:100033
法定代表人:田国立
联系电话:95533
客户电话:95533
公司网址:www.ccb.com

（5）交通银行股份有限公司
办公地址: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
联系电话:95559
传真:（021）58408483
客户电话:95559
公司网址:www.bankcomm.com

（6）招商银行股份有限公司
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮编:518040
法定代表人:李建红
联系人:邓炯鹏
联系电话:95555
客户电话:95555
公司网址:www.cmbchina.com

（7）中国民生银行股份有限公司
办公地址:北京市西城区西绒线胡同28号天安国际办公楼
邮编:100031
法定代表人:洪崎
联系人:王志刚
联系电话:95568
传真:010-57092611
客户电话:95568
公司网址:www.cmbc.com.cn

（8）渤海银行股份有限公司
办公地址:天津市河东区海河东路218号渤海银行大厦
邮编:300012
法定代表人:李伏安
联系人:王星
联系电话:400-888-8811
客户电话:95541
公司网址:www.cbhb.com.cn

（9）广发银行股份有限公司
办公地址:广东省广州市东风东路713号
邮编:510080
法定代表人:杨明生
联系电话:400-830-8003
客户电话:400-830-8003
公司网址:www.cgbchina.com.cn

（10）华夏银行股份有限公司
办公地址:北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦
邮编:100005
法定代表人:李民吉
联系电话:95577
客户电话:95577
公司网址:www.hxb.com.cn

（11）江苏银行股份有限公司
办公地址:南京市中华路26号
邮编:210001
法定代表人:夏平
联系电话:400-869-6098
客户电话:96098,40086-96098
公司网址:www.jsbchina.cn

（12）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
联系电话:95511
客户电话:95511-3
公司网址:www.bank.pingan.com

（13）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
联系电话:95528
传真:021-61162165
客户电话:95528
公司网址:www.spdb.com.cn

（14）中国邮政储蓄银行有限责任公司
办公地址:北京市西城区宣武门西大街131号
法定代表人:刘爱力
联系人:陈春林
联系电话:95580
客户电话:95580
公司网址:www.psbc.com

（15）中信银行股份有限公司
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街9号
邮编:100010
法定代表人:李庆萍
联系人:王晓琳
联系电话:95558
客户电话:95558
公司网址:www.citicbank.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
传真:010-61840699
客户电话:4000618518
公司网址:https://danjuanapp.com/

（17）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
传真:021-50498825
客户电话:95531;400-8888-588
公司网址:www.longone.com.cn

（18）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
联系电话:400-888-8993
传真:010-66555246
客户电话:400-8888-993、95309
公司网址:www.dxzq.net.cn

（19）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
联系电话:95525
传真:021-22169134
客户电话:95525
公司网址:www.ebscn.com

（20）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
联系电话:95575
客户电话:95575
公司网址:www.gf.com.cn

（21）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
传真:021-38670666
客户电话:95521
公司网址:www.gtja.com

（22）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
传真:0755-82133952
客户电话:95536
公司网址:www.guosen.com.cn

（23）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
联系电话:95553
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

（24）上海好买基金销售有限公司
办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室
客户电话:400-700-9665
公司网址:www.ehowbuy.com

（25）和讯信息科技有限公司
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
客户电话:400-920-0022
公司网址:www.licaike.com

（26）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
邮编:830002
法定代表人:李琦
联系人:陈飙
传真:0991-2301927
客户电话:400-800-0562
公司网址:www.hysec.com

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

（28）上海华夏财富投资管理有限公司
客户电话:400-817-5666

（29）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

（30）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

（31）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

（32）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

（33）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

（34）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
联系电话:4000-776-123
客户电话:4000-776-123
公司网址:http://www.fund123.cn/

（35）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司
办公地址:上海杨浦区秦皇岛路32号C栋 2楼
客户电话:400-821-5399
公司网址:www.noah-fund.com

（36）山西证券股份有限公司
办公地址:山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人:侯巍
联系人:韩笑
联系电话:400-666-1618
传真:0351-8686619
客户电话:400-666-1618、95573
公司网址:www.i618.com.cn

（37）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
传真:021-33388224
客户电话:95523
公司网址:www.swhysc.com

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

（39）深圳腾元基金销售有限公司
办公地址:深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806-1810
法定代表人:曾革
联系人:杨苗苗
联系电话:400-877-899
客户电话:4006-877-899
公司网址:www.tenyuanfund.com

（40）上海天天基金销售有限公司
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼
客户电话:400-1818-188
公司网址:www.1234567.com.cn

（41）浙江同花顺基金销售有限公司
办公地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
联系人:张丽琼
客户电话:4008-773-772
公司网址:www.5ifund.com

（42）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

（43）上海万得投资顾问有限公司
办公地址:中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
客户电话:400-821-0203

（44）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
联系电话:400-809-6096
传真:023-63786212
客户电话:4008-096-096
公司网址:www.swsc.com.cn

（45）北京新浪仓石基金销售有限公司
办公地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
客户电话:010-62675369
公司网址:www.xincai.com

（46）宜信普泽（北京）基金销售有限公司
办公地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
联系电话:400-6099-200
客户电话:400-6099-200
公司网址:www.yixinfund.com

（47）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

（48）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
联系电话:400-886-6567
传真:010-59562637
客户电话:400-8866-567
公司网址:www.avicsec.com

（49）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
传真:010-65058065
客户电话:400-910-1166
公司网址:www.cicc.com

（50）中经北证（北京）资产管理有限公司
办公地址:北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
客户电话:400-600-0030
公司网址:www.bzfunds.com

（51）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
联系电话:95538
传真:021-20315125
客户电话:95538
公司网址:www.zts.com.cn

（52）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
联系电话:010-60838677
传真:0755-83217421
客户电话:400-990-8826
公司网址:www.citicsf.com

（53）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
传真:010-60833739
客户电话:95548
公司网址:www.cs.ecitic.com

（54）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
邮编:266000
法定代表人:姜晓林
联系人:刘晓明
联系电话:95548
传真:0532-85022605
客户电话:95548
公司网址:www.zxwt.com.cn

（55）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
联系电话:400-678-8887
客户电话:400-678-8887
公司网址:www.zlfund.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

（二）注册登记机构

华宝基金管理有限公司
住所: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
法定代表人:孔祥情
电话:38505777
传真:38505888
网址:www.fsfund.com

（三）律师事务所和经办律师

名称:通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:韩炯
联系电话:(86 21) 3135 8666
传真: (86 21) 3135 8600
联系人:黎明
经办律师:吕红、黎明

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:中国上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
联系电话:(021) 23238888
传真:(021) 23238800
联系人:张勇
经办注册会计师:薛竞、张勇

五、基金简介

基金名称:华宝上证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

本基金以目标ETF、标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象,其中投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%;现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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%;同时为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于新股（首次公开发行或增发等）及中国证监会允许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%。

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。

（三）标的指数

本基金的标的指数即目标ETF的标的指数,为上证180价值指数。

本基金按照基金合同的约定通过适当程序变更目标ETF时,标的指数应相应变更。

（四）投资策略

本基金为目标ETF的联接基金,主要通过投资于目标ETF以达到投资目标。当本基金申购赎回和买卖目标ETF,或基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,本管理人会在10个交易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。

本基金对标的指数的跟踪目标是:在正常情况下,本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。

1、资产配置策略

本基金主要通过投资目标ETF、标的指数成份股和备选成份股来进行被动式指数化投资,达到跟踪指数的目标。因此,本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%;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%; 中国证监会允许的其他金融工具的投资比例不高于基金资产净值的5%。

2、基金投资策略

本基金对基金的投资仅限于目标ETF,现时目标ETF是上证180价值交易型开放式指数证券投资基金。

（1）投资组合的构建

基金合同生效后,在建仓期内本基金将按照标的指数成份股的基准权重构建股票组合,在目标ETF开放申购赎回后将股票组合换购成目标ETF,使本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%。

（2）目标ETF的投资方式

本基金可以通过申购赎回代理券商以成份股实物形式申购及赎回目标ETF基金份额,也可以通过券商在二级市场上买卖目标ETF基金份额。本基金将根据开放日申购赎回情况、综合考虑流动性、成本、效率等因素,决定目标ETF的投资方式。通常情况下,本基金以申购和赎回为主:当收到净申购时,本基金构建股票组合、申购目标ETF;当收到净赎回时,本基金赎回目标ETF、卖出股票组合。对于股票停牌或其他原因导致基金投资组合中出现的剩余成份股,本基金将选择作为后续实物申购目标ETF 的基础证券或者择机在二级市场卖出。本基金在二级市场上买卖目标ETF基金份额是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的。

（3）投资组合的调整

本基金将根据申购和赎回情况,结合基金的现金头寸管理,对基金投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数。

3、股票投资策略

本基金对于标的指数成份股和备选成份股部分的投资,采用被动式指数化投资的方法进行日常管理。针对我国证券市场新股发行制度的特点,本基金将参与一级市场新股认购。

4、债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要,将投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券,债券投资的目的是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。

5、其他金融工具投资策略

在法律法规许可时,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,以提高投资效率,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是出于追求基金充分投资、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。

（五）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）从事承担无限责任的投资;
（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和目标ETF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者承销期内承销的证券;
（7）从事内幕交易、操纵证券价格及其他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）项情形导致无法投资的标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,本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.本基金进入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.本基金在任何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.现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）和到期日不超过1年的政府债券不低于5%;
d.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%;
e.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%;
f.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合计规模的10%;
g.本基金财产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
h.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;
i.本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%;因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;
j.本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;
k.相关法律法规以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性规定,履行适当程序后,本基金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。

除上述第c、i、j项外,由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例,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、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产规模在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。

（六）业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:95%×上证180价值指数收益率+5%×银行同业存款利率。

本基金标的指数变更的,业绩比较基准将随之变更并公告。

（七）风险收益特征

本基金为ETF联接基金,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2018年9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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,697,231.60	1.95
	其中:股票	2,697,231.60	1.95
2	基金投资	126,182,292.99	91.13
3	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
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	银行存款和结算备付金合计	9,391,146.03	6.78
8	其他资产	195,120.59	0.14
9	合计	138,465,791.21	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末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、渔业	–	–
B	采矿业	121,940.00	0.09
C	制造业	340,616.00	0.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	145,682.00	0.11
E	建筑业	238,719.00	0.18
F	批发和零售业	19,394.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	87,290.00	0.06
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	1,613,486.60	1.19
K	房地产业	130,104.00	0.10
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	–	–
	合计	2,697,231.60	1.98

(2)报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

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	4,800	328,800.00	0.24
2	601166	兴业银行	9,700	154,715.00	0.11
3	600016	民生银行	22,040	139,733.60	0.10
4	601328	交通银行	21,400	124,976.00	0.09
5	601288	农业银行	29,700	115,533.00	0.08
6	600000	浦发银行	9,100	96,642.00	0.07
7	601398	工商银行	16,700	96,359.00	0.07
8	600104	上汽集团	2,800	93,184.00	0.07
9	601668	中国建筑	16,300	89,487.00	0.07
10	601601	中国太保	2,400	85,224.00	0.06

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名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名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例(%)
1	上证180价值ETF	指数型	交易型开放式	华宝基金管理有限公司	126,182,292.99	92.76

10、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。

11、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。

12、投资组合报告附注

（1）上证180价值ETF联接基金截至2018年9月30日持仓前十名证券中的兴业银行（601166）于2018年5月4日收到银保监会处罚通知。由于公司存在:（一）重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告;（二）非真实转让信贷资产;（三）无授信额度或超授信额度办理同业业务;（四）内控管理严重违反审慎经营规则,多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规;（五） 同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保;（六）债券卖出回购业务违规出表;（七）个人理财资金违规投资;（八）提供日期倒签的材料;（九）部分非现场监管统计数据与事实不符;（十）个别董事未经任职资格核准即履职;（十一）变相批量转让个人贷款;（十二）向四证不全的房地产项目提供融资;被处以罚款。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析,认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响,因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内,本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

（2）本基金本报告期末未持有股票投资。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,256.30
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	1,696.02
5	应收申购款	188,168.27
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	195,120.59

（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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

八、基金的业绩

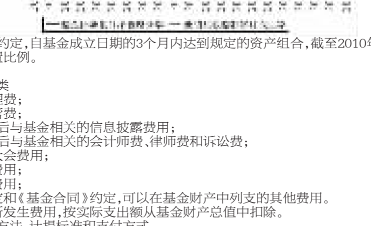
本基金业绩数据为截止2018年9月30日的数据,本报告中所列数据未经审计。

1、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
2010/04/23-2010/12/31	-2.69%	1.33%	-10.44%	1.58%	7.75%	-0.25%
2011/01/01-2011/12/31	-13.94%	1.23%	-14.92%	1.21%	0.98%	0.02%
2012/01/01-2012/12/31	15.34%	1.10%	13.00%	1.09%	2.34%	0.01%
2013/01/01-2013/12/31	-9.47%	1.49%	-11.98%	1.46%	2.51%	0.03%
2014/01/01-2014/12/31	67.22%	1.33%	63.46%	1.34%	3.76%	-0.01%
2015/01/01-2015/12/31	0.70%	2.27%	0.84%	2.35%	-0.14%	-0.08%
2016/01/01-2016/12/31	-5.09%	1.24%	-6.30%	1.26%	1.21%	-0.02%
2017/01/01-2017/12/31	26.65%	0.64%	22.18%	0.66%	4.47%	-0.02%
2018/01/01-2018/09/30	-3.82%	1.14%	-6.87%	1.16%	3.05%	-0.02%
2010/04/23-2018/09/30	76.12%	1.36%	36.83%	1.40%	39.29%	-0.04%

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

华宝上证180价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金
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
（2010年4月23日至2018年9月30日）



注:按照基金合同的约定,自基金成立日期的3个月内达到规定的资产组合,截至2010年7月底,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金的证券交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、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

本基金基金财产中目标ETF的部分不收取管理费,在通常情况下,扣除基金财产中目标ETF份额所对应的基金资产净值后剩余部分基金资产的基金管理费按前一日该部分基金资产净值的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=MAX (E×0.5%÷当年天数,0)

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分的基金资产净值

基金管理费每日计算,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管理费划款指令,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。

2、基金托管人的托管费

本基金基金财产中目标ETF的部分不收取托管费,在通常情况下,扣除基金财产中目标ETF份额所对应的基金资产净值后剩余部分基金资产的基金托管费按前一日该部分基金资产净值的0.1%年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=MAX (E×0.1%÷当年天数,0)

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分的基金资产净值

基金托管费每日计算,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取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述一、基金费用的种类中第3-8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的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,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

（五）基金税收

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《华宝上证180价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》作如下更新:

1、"三、基金管理人"更新了基金管理人的相关信息。
2、"四、基金托管人"更新了基金托管人的相关信息。
3、"五、相关服务机构"更新了本基金代销机构的相关信息。
4、"九、与基金管理人管理的其他基金转换"更新了本基金与其他基金转换的相关信息。
5、"十、基金的投资"更新了截至2018年9月30日的基金的投资组合报告。
6、"十一、基金的业绩"更新了截至2018年9月30日的基金业绩数据。
7、"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12月5日