华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金（LOF）上市交易公告书

基金管理人:华宝基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
登记机构:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:上海证券交易所
上市日期:2019年3月5日
公告日期:2019年2月28日

一、重要声明与提示

《华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金（LOF）上市交易公告书》（以下简称"本公告"）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称"《基金法》"）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金（LOF）（以下简称"本基金"）管理人华宝基金管理有限公司的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中国银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、上海证券交易所对华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金（LOF）上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

本公告书第七节"基金财务状况"未经审计。

凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在2018年11月13日《证券时报》及华宝基金管理有限公司网站（www.fsfund.com）上的《华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金（LOF）招募说明书》以及同日发布在本公司网站（www.fsfund.com）上的《华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称"基金合同"）。

二、基金概览

（一）基金名称:华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金（LOF）
（二）基金类别:股票型证券投资基金
（三）基金运作方式:上市契约型开放式（LOF）
（四）基金份额总额:截至2019年2月26日，本基金的基金份额总额:279,640,252.85份
（五）基金份额净值:截至2019年2月26日，本基金份额净值:1.0015元
（六）本次上市交易的基金份额总额:56,816,485.00份
（七）上市交易的证券交易所:上海证券交易所
（八）上市交易日期:2019年3月5日
（九）基金管理人:华宝基金管理有限公司
（十）基金托管人:中国银行股份有限公司
（十一）上市推荐人:光大证券股份有限公司、中银国际证券股份有限公司
（十二）本次上市交易的基金份额登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金募集情况
1、本基金准予募集注册的机构和文号:中国证监会证监许可【2018】1058号
2、基金合同生效日:2019年1月24日
3、发售日期:2018年11月26日起至2019年1月18日
4、发售价格:人民币1.00元
5、发售方式:场内、场外认购
6、发售机构:
（1）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。
（2）场外销售机构
①直销机构
本公司直销柜台和直销e网金。
②代销机构
上海浦东发展银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、安信证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券有限公司、太平洋证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信期货有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信证券股份有限公司、中银国际证券股份有限公司、上海天天基金销售有限公司、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司、北京蛋卷基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司、上海华夏财富投资管理有限公司、上海基煜基金销售有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、北京肯特瑞基金销售有限公司、上海联泰资产管理有限公司、上海陆金所资产管理有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司、南京苏宁基金销售有限公司、上海大智慧基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、上海挖财金融信息服务有限公司、上海万得基金销售有限公司、北京新浪仓石基金销售有限公司、宜信普泽（北京）基金销售有限公司、奕丰基金销售有限公司、北京创金启富投资管理有限公司、深圳众禄基金销售股份有限公司、珠海盈米基金销售有限公司、北京百度百盈基金销售有限公司、深圳前海微众银行股份有限公司、腾安基金销售（深圳）有限公司。
7、验资机构名称:德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
8、募集资金总额及入账情况
本次募集的有效净认购金额为279,582,007.96元人民币，折合基金份额279,582,007.96份；利息结转份额58,244.89份，总确认份额为279,640,252.85份。上述有效净认购资金及认购款项在募集期间产生的利息已于2019年1月22日全额划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金（LOF）托管专户。
本基金通过场外、场内两种方式公开发售，按照每份基金份额1.00元计算，本基金募集期间含本息共募集279,640,252.85份基金份额，其中场外认购的基金份额为222,823,767.85份；场内认购的基金份额为56,816,485.00份。
9、本基金募集备案情况
本基金于2019年1月22日验资完毕，2019年1月23日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于2019年1月24日获得《关于华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金（LOF）备案确认的函》（机构部函【2019】204号）的书面确认，本基金基金合同自该日起正式生效。
10、基金合同生效日:2019年1月24日
11、基金合同生效日的基金份额总额:279,640,252.85份
（二）本基金日常申购、赎回情况
本基金将于2019年3月5日开放日常申购、赎回业务，详细信息请投资者查阅刊登在2019年2月28日《中国证券报》及本公司网站（www.fsfund.com）上的《华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金（LOF）开放日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告》。
（三）本基金上市交易的主要内容
1、基金上市交易的核准机构和核准文号:上海证券交易所自律监管决定书[2019]32号
2、上市交易日期:2019年3月5日
3、上市交易的证券交易所:上海证券交易所
4、基金场内简称:质量基金(基金代码:501069)
5、本次上市交易份额:56,816,485.00份（截至2019年2月26日）
6、未上市交易份额的流通规定:持有人通过场外代销机构持有的基金份额，需转托管至上海证券交易所场内后即可上市流通。
7、基金资产净值的披露:在本基金上市交易后或开始办理申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金销售机构以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值，并在上交所行情发布系统揭示。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数
截至2019年2月26日，本基金基金份额持有人总户数为10,632户，其中场内份额持有人户数为176户，平均每户持有的场内基金份额为322,820.94份；场外份额持有人户数为10,456户，平均每户持有的场外基金份额为21,310.61份。
（二）持有人结构
1、截至2019年2月26日，场内基金份额持有人结构如下:
截至2019年2月26日，本基金场内投资者持有基金份额56,816,485.00份。其中，场内机构投资者持有的基金份额为11,496,033.00份，占基金场内总份额的20.23%；场内个人投资者持有的基金份额为45,320,452.00份，占基金场内总份额的79.77%。
2、截至2019年2月26日，基金管理人的从业人员持有本基金场内份额的情况如下:

项目	持有份额总数（份）	占场内总份额比例（%）
基金管理公司所有从业人员持有本基金	0	0

（三）截至2019年2月26日，场内前十名基金份额持有人情况

序号	持有人名称	持有份额（份）	占场内总份额比例（%）
1	庄朝荣	7,501,375.00	13.20%
2	广发证券股份有限公司	6,000,080.00	10.56%
3	深圳市信利康电子有限公司	4,999,900.00	8.80%
4	朱锁华	1,999,090.00	3.52%
5	许秀鑫	1,492,604.00	2.63%
6	唐丽榕	1,213,984.00	2.14%
7	李云芳	1,194,083.00	2.10%
8	武瑞霞	1,005,020.00	1.77%
9	高焕清	995,249.00	1.75%
10	陆晓华	995,204.00	1.75%

注:以上信息依据中国证券登记结算有限公司上海分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人介绍

（一）基金管理人
1、公司概况
名称:华宝基金管理有限公司
法定代表人:孔祥清
总经理:HUANG Xiaoyi Helen（黄小薏）
注册资本:人民币1.5亿元
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
设立批准文号:中国证监会证监基金字[2003]19号
工商登记注册的法人营业执照文号:310000400334472
经营范围:发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营）
成立日期:2003年3月7日
股东名称及其出资比例:中方股东华宝信托有限责任公司持有51%的股份，外方股东Warburg Pincus Asset Management, L.P.持有49%的股份。
2、内部组织结构及职能
公司下设31个部门，包括:研究部、国内投资部、固定收益部、机构投资部、量化投资部、国际业务部、多元资产管理部、养老金部、监察稽核部、风险管理部、北京分公司、深圳分公司、营销中心（西部、北方、东部、南方）、机构及海外销售部、产品开发部、专户营销部、互金业务部、互金展业部、客户服务部、营销管理部、战略规划部、交易部、清算登记部、信息技术部、财务部、人力资源部、综合管理部、党群工作部。
各部门主要职责概述如下:
研究部:从事宏观经济、行业及上市公司、投资策略等方面的研究并为基金投资决策及新产品开发提供基础支持，包括宏观研究、策略研究、行业研究、金融工程研究和债券研究。
国内投资部:负责公募基金资产投资国内证券市场的日常管理和运作，在认真研究和充分论证的基础上，拟定基金投资策略和投资组合方案，经投资决策委员会批准后具体实施，并对实施过程中出现的问题进行反馈和调整。
机构投资部:负责专户资产帐户等非公募基金的投资管理业务和投资咨询业务。
国际业务部:负责公司QDII公募基金资产投资海外证券市场的日常管理和运作。
量化投资部:负责管理主动和被动量化基金，开展数量化投资策略研究。
固定收益部:主要职责是搜寻债券投资机会，并制定和实施相应的债券投资策略；进行债券分析，包括宏观经济趋势、利率政策、相对价值、信用债券；投资组合构造、优化和管理，包括风险控制、流动性管理。
多元资产管理部:负责跨资产研究；基金等资产配置产品研究；负责投资组织策略开发与投资交易运作；开展业务营销工作。
养老金部:负责公司社保基金、年金管理资格的申请；制定社保基金、企业年金的产品设计与创新；制定相关投资策略，开展投资管理运作；负责社保基金、企业年金的市场推广与客户开发等。
产品开发部:负责公司产品开发研究，在法律、法规和政策许可的条件下，根据市场需求的变化和特点，不断开发新的基金品种、拓展公司的业务范围，寻找公司新的利润增长点。
北京分公司:主要负责维护公司在北方地区机构销售。
深圳分公司:主要负责维护公司在南方地区机构销售。
机构及海外销售部:主要职能是负责维护公司在华东地区机构销售。
营销中心:主要负责维护公司各大区域的渠道销售。
互金展业部:负责互联网金融客户拓展；互联网金融运维统筹；互联网金融直销的网上互动服务。
互金策划部:负责互联网金融产品研发；互联网金融内容产生；投顾支持；公司官宣。
机构及海外销售部:主要职能是负责为机构客户和海外客户销售公募产品和提供相关服务，为特定客户进行一站式服务，拓展客户资源，提高公司在业内的市场份额。业务范围包括:公募基金销售、专项资产委托管理、QDII海外投资及为大型机构提供其他理财或投资咨询服务等。
营销管理部:负责公募基金销售渠道管理和维护；公募基金销售团队的考核管理；销售会务管理。
客户服务部:负责Call Center的管理和客户服务工作，协助互联网金融的网上互动服务。
专户营销部:负责向机构客户、高端个人客户和渠道销售特定资产管理产品（即专户产品），提高公司在业内特定资产管理业务的市场份额。
战略规划部:负责公司战略发展规划及中长期发展目标的制定和实施、协助管理层与股东间的沟通交流、牵头公司重大项目的开展。
交易部:负责接受基金经理下达的投资指令，在确认投资指令的有效性后以执行；及时整理交易记录，按照有关规定存档；及时反馈与交易相关的信息等。
清算登记部:负责基金交易的资金调拨、交易清算；组织基金会计核算，对基金名下所发生的投资交易、资金往来等各种事项进行全面、及时、真实的会计核算；与托管行核对帐目，定期公布相关财务报表和会计报告；负责基金绩效评估；负责开放式基金的注册登记等。
信息技术部:负责公司信息系统的日常维护；交易、清算、咨讯所需电脑信息的收集、整理和备份；负责设计、建立及维护开放式基金的业务运作系统；负责公司办公电脑软硬件的配置、维护，信息集成系统的安装、开通与调试。
人力资源部:负责公司的人力资源管理政策的制定与落实。
综合管理部:负责公司的行政及后勤管理；文档与会议管理；负责公司的企业文化建设；负责公司的安全保卫工作。
财务部:负责公司的财务会计工作，账务处理，编制公司财务报告；承办公司自有资金的运作等。
党群工作部:负责执行党总支各项工作要求；负责党总支各类工作及会议管理；具体落实相关党务工作；指导工会、共青团等群众组织的工作开展。
监察稽核部:根据公司业务发展，负责公司内部控制的评估及相应制度完善，对公司新业务、新产品的合规性提出意见建议，对公司的投资业务、市场业务、与基金相关事务及公司行为的合规监控，对公司投资管理、市场营销、公司运营等业务的合规稽核，对公司的各类信息披露的审核及部分内容的披露，反洗钱事务，落实公司风险控制委员会和公司管理层的决议，根据公司管理层的指示，负责公司内外部相关的协调、沟通。
风险管理部:负责公司投资组合的风险评估，根据投资组合风险评估结果向投资决策机构提供风险管理建议，对公司新的基金、专户产品的风险特征进行分析并提出风险管理措施建议，落实公司风险控制委员会的决议，根据公司管理层的指示，负责公司风险管理工作与公司内外部相关的协调、沟通。
信息披露负责人:刘月华；021-38505888
截至2018年12月31日，我公司共有员工256人，其中博士及博士以上有8人，硕士153人，本科84人，专科及以下11人。
3、基金管理业务情况
截至2018年12月31日，华宝基金管理有限公司旗下共管理62只开放式基金，资产管理规模为167,457,512,458.20元。旗下管理的基金为:华宝宝康系列基金、华宝多策略基金、华宝现金宝货币市场基金、华宝动力组合基金、华宝收益增长基金、华宝先进成长基金、华宝行业精选基金、华宝海外中国成长基金、华宝大盘精选基金、华宝增强收益基金、华宝中证100基金、上证180价值ETF、华宝上证180价值ETF联接基金、华宝新兴产业基金、华宝可转债基金、华宝油气基金、华宝医药生物基金、华宝资源优选基金、华宝添益货币市场基金、华宝服务优选基金、华宝创新优选基金、华宝生态中国基金、华宝量化对冲基金、华宝高端制造基金、华宝品质生活基金、华宝稳健回报基金、华宝事件驱动基金、华宝国策导向基金、华宝新价值基金、华宝新机遇基金、华宝医疗分级基金、华宝中证1000分级基金、华宝万物互联基金、华宝转型升级基金、华宝核心优势基金、华宝美国消费基金、华宝香港中小盘基金、华宝中证全指证券公司ETF、华宝中证军工ETF、华宝新活力基金、华宝沪深300指数增强基金、华宝未来主导产业基金、华宝新起点基金、华宝红利基金、华宝新飞跃基金、华宝新优选基金、华宝香港大盘基金、华宝智慧产业基金、华宝第三产业基金、华宝银行ETF、华宝银行ETF联接基金、华宝价值发现基金、华宝香港本地基金、华宝中证500指数增强基金、华宝香港精选基金、华宝券商ETF联接基金、华宝绿色主题基金、华宝沪港深价值基金。
4、本基金基金经理
胡洁女士，硕士。2006年6月加入华宝基金管理有限公司，先后在交易部、产品开发部和量化投资部工作，现任量化投资部副总经理。2012年10月至2019年1月任上证180成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2012年10月至2018年11月任华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2015年5月起任华宝中证医疗指数分级证券投资基金基金经理，2015年6月至2018年8月任华宝中证1000指数分级证券投资基金基金经理，2016年8月起任华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2017年1月起任华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)基金经理，2017年7月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2018年11月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2019年1月起任华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金（LOF）基金经理。

（二）基金托管人
（一）基本情况
名称:中国银行股份有限公司（简称"中国银行"）
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期:1983年10月31日
注册资本:人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整
法定代表人:陈四清
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24号
托管部门信息披露联系人:王永民
传真:（010）66594942
中国银行客服电话:95566
（二）基金托管部门及主要人员情况
中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外设立托管业务机构。
作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。
（三）证券投资基金托管情况
截至2018年9月30日，中国银行已托管679只证券投资基金，其中境内基金642只，QDII基金37只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。
（四）托管业务的内部控制制度
中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持"规范运作、稳健经营"的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。
2007年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于"SAS70"、"AAF01/06"、"ISAE3402"和"SSAE16"等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年，中国银行继续获得了基于"ISAE3402"和"SSAE16"双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。
（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序
根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

（三）验资机构
名称:德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
注册地址:中国上海市黄浦区延安东路222号外滩中心30楼
办公地址:中国上海市黄浦区延安东路222号外滩中心30楼
执行事务合伙人: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

六、基金合同的内容摘要

详见本公告书附件。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用
本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付，各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。
（二）基金上市前重要财务事项
本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
（三）基金资产负债表
本基金截至2019年2月26日的资产负债表如下:

资产	本报告期末 2019年2月26日
资产:	
银行存款	279,535,482.12
结算备付金	507,727.27
存出保证金	
交易性金融资产	
其中:股票投资	
债券投资	
资产支持证券投资	
衍生金融资产	
买入返售金融资产	
应收证券清算款	
应收利息	198,046.25
应收股利	
应收申购款	
其他资产	
资产总计	280,241,255.64
负债和所有者权益	本报告期末 2019年2月26日
负债:	
短期借款	
交易性金融负债	
衍生金融负债	
卖出回购金融资产款	
应付证券清算款	
应付赎回款	
应付管理人报酬	149,534.81
应付托管费	19,937.99
应付销售服务费	
应付交易费用	
应交税费	
应付利息	
应付利润	
其他负债	11,925.94
负债合计	181,398.74
所有者权益:	
实收基金	279,640,252.85
未分配利润	419,604.05
所有者权益合计	280,059,856.90
负债和所有者权益总计	280,241,255.64

注:截至2019年2月26日，基金份额净值1.0015元，基金份额总额279,640,252.85份。

八、基金投资组合

截至2019年2月26日，本基金的投资组合如下:
（一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	–	–
	其中:股票	–	–
2	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	280,043,209.39	99.93
7	其他资产	198,046.25	0.07
8	合计	280,241,255.64	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合
1.报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合
截至2019年2月26日，本基金未持有指数部分的股票投资。
2.报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合
截至2019年2月26日，本基金未持有积极投资部分的股票投资。
（三）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
1.报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
截至2019年2月26日，本基金未持有指数部分的股票投资。
2.报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
截至2019年2月26日，本基金未持有积极投资部分的股票投资。
（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合
截至2019年2月26日，本基金未持有债券投资。
（五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
截至2019年2月26日，本基金未持有债券投资。
（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
截至2019年2月26日，本基金未持有资产支持证券。
（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
截至2019年2月26日，本基金未持有贵金属投资。
（八）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
截至2019年2月26日，本基金未持有权证。
（九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
1. 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金未投资股指期货。
2. 本基金投资股指期货的投资政策
本基金未投资股指期货。
（十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
1. 本期国债期货投资政策
本基金未投资国债期货。
2. 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金未投资国债期货。
3. 本期国债期货投资评价
本基金未投资国债期货。
（十一）投资组合报告附注
1.自基金合同生效日至2019年2月26日，本基金前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。
2.本基金前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
3.其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	198,046.25
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	198,046.25

4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
截至2019年2月26日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。
5.报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
（1）报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
截至2019年2月26日，本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。
（2）报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
截至2019年2月26日，本基金未持有积极投资的股票。

九、重大事件揭示

本基金基金合同已于2019年1月24日正式生效，基金管理人已于2019年1月25日在《中国证券报》刊登《华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金（LOF）基金合同生效公告》。

十、基金管理人承诺

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

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:
（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定和约定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。
（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定和约定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理费的计提和支付、基金托管费的计提和支付等行为进行监督和核查。
（三）基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时通知基金管理人限期纠正，并在限期内随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。
（四）基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人就本基金上市交易事宜出具意见如下:
（一）本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件。
（二）基金上市文件真实、准确、完整，符合规定要求，文件内所载的资料均经过核实。

十三、备查文件目录

（一）本基金备查文件包括下列文件:
1、中国证监会准予华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金（LOF）募集注册的文件；
2、《华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
3、《华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
4、法律意见书；
5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
7、中国证监会要求的其他文件。
（二）备查文件的存放地点和投资者查阅方式:
以上备查文件存放在基金管理人和基金托管人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

附件:基金合同摘要

（一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于:
（1）依法募集资金；
（2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
（3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
（4）销售基金份额；
（5）按照规定召集基金份额持有人大会；
（6）依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
（10）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；
（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
（14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换等业务的业务规则；
（17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于:
（1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
（2）办理基金备案手续；
（3）自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
（6）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
（7）依法接受基金托管人的监督；
（8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；
（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
（10）编制季度、半年度和年度基金报告；
（11）严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
（13）按《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基金收益；
（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
（15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上；
（17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；
（18）组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
（19）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
（20）因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
（21）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；
（23）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实施其他法律行为；
（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；
（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
（26）建立并保存基金份额持有人名册；
（27）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。
3、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于:
（1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；
（2）依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；
（3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
（4）根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；
（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；
（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
（7）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
4、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于:
（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
（2）设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
（3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
（4）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
（6）按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货结算账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
（7）保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；
（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
（10）对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人有未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上；
（12）建立并保存基金份额持有人名册；
（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
（14）依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
（15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
（16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
（18）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；
（19）因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
（20）按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。
5、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于:
（1）分享基金财产收益；
（2）参与分配清算后的剩余基金财产；
（3）依法申请赎回或转让其持有的基金份额；
（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
（5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
（6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
（7）监督基金管理人的投资运作；
（8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
（9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
6、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于:
（1）认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
（2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
（3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
（4）缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
（5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
（6）不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
（7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
（8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
（9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（二）基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则
基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。
本基金份额持有人大会不设日常机构。
1、召开事由
（1）当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，法律法规、中国证监会或基金合同另有规定的除外:
1)终止《基金合同》；
2)更换基金管理人；
3)更换基金托管人；
4)转换基金运作方式；
5)调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；
6)变更基金类别；
7)本基金与其他基金的合并；
8)变更基金投资目标、范围或策略；
9)变更基金份额持有人大会程序；
10)基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
11)单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
12)对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
13)终止上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外；
14)法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。
（2）以下情况在法律法规和《基金合同》规定的范围内并在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会:
1)调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
2)因相应的法律法规、上海证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动而对《基金合同》进行修改；
3)对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
4)按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。
2、会议召集人及召集方式
（1）除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。
（2）基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。
（3）基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。
（4）代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。
（5）代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前30日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。
（6）基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。
3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式
（1）召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前30日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容:
1)会议召开的时间、地点和会议形式；
2)会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
3)有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
4)授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
5)会务常设联系人姓名及联系电话；
6)出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
7)召集人需要通知的其他事项。
（2）采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。
（3）如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。
4、基金份额持有人出席会议的方式
基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式等法律法规和监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。
（1）现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程:
1)亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；
2)经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。
若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。
（2）通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以会议通知载明的形式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。
在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效:
1)会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；
2)召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；
3)本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；
若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；
4)上述第3）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。
（3）在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，本基金可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯开会的程序进行。基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。
5、议事内容与程序
（1）议事内容及提案权
议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。
基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。
基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。
（2）议事程序
1)现场开会
在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第7条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。
会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。
2)通讯开会
在通讯开会的情况下，首先由召集人提前30日公布提案，在所通知的表决截止日期后2个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。
6、表决
基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。
基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:
（1）一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第（2）项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。
（2）特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。
基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。
采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。
基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。
7、计票
（1）现场开会
1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。
2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。
3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。
4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。
（2）通讯开会
在通讯开会的情况下，计票方式为:由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。
8、生效与公告
基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。
基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。
基金份额持有人大会决议自生效之日起2日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。
基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。
9、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

（三）基金收益分配原则、执行方式
1、基金利润的构成
基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。
2、基金可供分配利润
基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。
3、基金收益分配原则
1）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配；
2）本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在证券登记系统基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；
3）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
4）每一基金份额享有同等分配权；
5）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。
4、收益分配方案
基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。
5、收益分配方案的确定、公告与实施
本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。
基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。
6、基金收益分配中发生的费用
基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。对于场外份额，当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。对于场内份额，现金分红的计算方法等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。
（四）与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例
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；
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、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/期货交易费用；
8）基金的银行汇划费用；
9）账户开户费用和账户维护费；
10）基金上市费用和年费；
11）按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。
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0.75%年费率计提。管理费的计算方法如下:
$H＝E×0.75\%÷当年天数$
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，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人自动在月初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。若遇不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日。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0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
$H＝E×0.1\%÷当年天数$
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，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人自动在月初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。若遇不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日。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。标的指数使用相关费用的费率、具体计算方法及支付方式见招募说明书。
如果指数使用许可协议约定的标的指数使用相关费用的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算标的指数使用相关费用。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露本基金最新适用的方法。
上述"1、基金费用的种类"中第4）－11）项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。
（五）基金财产的投资方向和投资限制
1、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0.35%，年化跟踪误差不超过4%。
2、投资范围
本基金的投资范围包括标的指数成份股、备选成份股、国内依法发行上市的其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。
本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。
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:
本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券。
3、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
本基金主要采取完全复制法，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）债券投资策略
本基金债券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。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变动走势，并利用债券定价技术，进行个券选择。
（4）资产支持证券投资策略
本基金将通过对宏观经济、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同，控制信用风险和流动性风险的前提下，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。
（5）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。
（6）融资及转融通投资策略
本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资及转融通业务。本基金将根据市场情况和组合风险收益，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资及转融通业务的法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。
（7）其他金融工具投资策略
如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他金融产品，基金管理人将根据监管机构的规定及本基金的投资目标，在履行适当程序后制定与本基金相适应的投资策略、比例限制、信息披露方式等。
4、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份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%；
2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%；
3）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；
4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；
5）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；
6）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；
7）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%；
8）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%；
9）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%；
10）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；
11）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
12）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%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；
13）本基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求:
a）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；
b）本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；
c）本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；
d）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；
e）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；
14）本基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；
15）本基金参与融资业务后，在任何交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；
16）本基金参与转融通证券出借业务，在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的50%，证券出借的平均剩余期限不得超过30天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；
17）本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资；
18）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；
19）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；
20）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。
除上述第2）、10）、18）、19）项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。
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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本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。
（2）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）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
5）向其基金管理人、基金托管人出资；
6）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；
7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。
基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。
法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。
（六）基金资产净值的计算方法和公告方式
1、基金资产净值的计算方法
基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值。
2、基金资产净值的公告方式
《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。
在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金销售机构以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。
基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。
（七）基金合同解除和终止的事由、程序
1、《基金合同》的变更
（1）变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。
（2）关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议生效后方可执行，自决议生效后两日内在指定媒介公告，并在决议生效后6日内报中国证监会备案。
2、《基金合同》的终止事由
有下列情形之一的，《基金合同》应当终止:
（1）基金份额持有人大会决定终止的；
（2）基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
（3）《基金合同》约定的其他情形；
（4）相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。
3、基金财产的清算
（1）基金财产清算小组:自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。
（2）基金财产清算小组组成:基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。
（3）基金财产清算小组职责:基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。
（4）基金财产清算程序:
1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
3）对基金财产进行估值和变现；
4）制作清算报告；
5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
6）将清算报告报中国证监会备案并公告；
7）对基金剩余财产进行分配。
（5）基金财产清算的期限为6个月。
4、清算费用
清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。
5、基金财产清算剩余资产的分配
依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。
6、基金财产清算的公告
清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。
7、基金财产清算账册及文件的保存
基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。
（八）争议解决方式
各方当事人同意，因《基金合同》产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。
争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。《基金合同》受中国法律管辖。
（九）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式
《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金（LOF）开放日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告

公告送出日期:2019年2月28日

1 公告基本信息

基金名称	华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金（LOF）
基金简称	华宝标普中国A股质量价值指数（场内简称"质量基金"）
基金主代码	501069
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2019年1月24日
基金管理人名称	华宝基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司
基金注册登记机构名称	中国证券登记结算有限责任公司
公告依据	《华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金（LOF）招募说明书》及有关规定
申购起始日	2019年3月5日
赎回起始日	2019年3月5日
定期定额投资起始日	2019年3月5日

2 日常申购、赎回、定期定额投资业务的办理时间
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、深圳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。
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。

3 日常申购业务
3.1 申购金额限制
1、投资者通过其他场外销售机构和直销e网金申购本基金单笔最低金额为1元人民币（含申购费）。通过直销柜台首次申购的最低金额为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）。已有认购本基金记录的投资者不受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，以各场外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、除本基金招募说明书第九部分"拒绝或暂停申购的情形"另有约定外，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，但法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外。
5、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。
6、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。
3.2 申购费率
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（元）	申购费率
100万以下	1.00%
大于等于100万，小于200万	0.60%
200万（含）以上	按笔收取，1000元/笔

申购费用由投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记费等各项费用。
本公司直销e网金申购费率优惠详见公司网站。

4 日常赎回业务
4.1 赎回份额限制
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某一销售机构的某一交易账户内保留的基金份额余额不足1份的，在赎回时需一次全部赎回。
4.2 赎回费率
本基金的赎回费率表如下，场内赎回费率与场外赎回费率相同。

持有基金份额期限	赎回费率
小于7日	1.5%
大于等于7日，小于6个月	0.50%
大于等于6个月，小于1年	0.25%
大于等于1年	0

注:此处一月按30日计算，一年按365日计算
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。

5定期定额投资业务
（1）开通定期定额投资业务的场外销售机构
直销机构:本公司直销e网金（目前华宝直销e网金的定期定额投资业务适用于建设银行卡、工商银行卡、农业银行卡、招商银行卡、兴业银行卡、易宝支付、天天盈账户）及移动客户端（工薪宝APP、微信平台）。
代销机构:本次开通基金定期定额投资业务的代销机构有上海浦东发展银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、安信证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券有限公司、太平洋证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信期货有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信证券股份有限公司、中银国际证券股份有限公司、上海天天基金销售有限公司、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司、北京蛋卷基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司、上海华夏财富投资管理有限公司、上海基煜基金销售有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、北京肯特瑞基金销售有限公司、上海联泰资产管理有限公司、上海陆金所资产管理有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司、南京苏宁基金销售有限公司、上海大智慧基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、上海挖财金融信息服务有限公司、上海万得基金销售有限公司、北京新浪仓石基金销售有限公司、宜信普泽（北京）基金销售有限公司、奕丰基金销售有限公司、北京创金启富投资管理有限公司、深圳众禄基金销售股份有限公司、珠海盈米基金销售有限公司、北京百度百盈基金销售有限公司、深圳前海微众银行股份有限公司、腾安基金销售（深圳）有限公司。
各代销机构开始办理基金定期定额投资业务的时间、网点等信息，请以各代销机构的规定为准。若增加新的代销机构，本公司将及时公告，敬请投资者留意。
（2）申请方式
投资者应按照销售机构的规定办理定期定额投资业务。
（3）扣款金额
投资者可与各代销机构约定每期固定扣款金额，具体最低扣款金额以各代销机构的规定为准。投资者通过本公司直销e网金办理本基金的定期定额投资业务时，每期扣款金额最低不少于人民币1元（含申购费）。
（4）扣款日期
投资者应遵循销售机构的规定并与销售机构约定每期固定扣款日期。如果在约定的扣款日前投资者开办定期定额投资业务的申请得到成功确认，则首次扣款日为当月，否则为次月。
（5）扣款方式
销售机构将按照投资者申请时所约定的每期固定扣款日、扣款金额扣款，若遇非基金开放日则顺延到下一基金开放日；如因投资者提交变更、解约等申请而使扣款信息与登记机构确认的约定信息不符或基金管理人发布暂停定期定额投资业务公告等情况，则此次扣款不成功。投资者需指定一个销售机构认可的资金账户作为每期固定扣款账户。如投资者账户余额不足的，应遵循相关销售机构的规定处理。
（6）申购费率
若无另行公告，定期定额申购费率与正常的申购业务费率相同。部分销售机构处于定期定额申购费率优惠活动（包括网上交易）期间的，本基金将依照各销售机构的相关规定执行。本公司直销e网金的定期定额优惠申购费率详见本公司的公告及网站。
（7）交易确认
每期实际扣款日即为基金申购申请日，并以该日（T日）的基金份额净值为基准计算申购份额，投资者可自T+2日起查询本基金定期定额申购确认情况。
（8）变更与终止
投资者变更每期扣款金额、扣款日期、扣款账户、指定基金等，须携带本人有效身份证件及相关凭证到原销售机构申请办理业务变更，具体办理程序遵循各销售机构的规定。
投资者终止定期定额投资业务，须携带本人有效身份证件及相关业务资料到原销售机构申请办理业务终止，具体办理程序遵循各销售机构的有关规定。
定期定额投资业务变更和终止的生效日遵循各销售机构的具体规定。

6 基金销售机构
6.1 场外销售机构
6.1.1 直销机构
本基金直销机构为华宝基金管理有限公司(以下简称"本公司")直销柜台、直销e网金、移动客户端（工薪宝APP、微信平台）。
（1）本公司直销柜台
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(200120)
直销柜台电话:021-38505731、38505732、021-38505888-301或302
直销柜台传真:021-50499663、50988055
（2）投资者可以通过本公司直销e网金、移动客户端（工薪宝APP、微信平台）办理基金的申购、赎回等业务，具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。
本公司网址:www.fsfund.com，客户服务中心电话:400-700-5588/021-38924558。
6.1.2 场外代销机构
(1)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
法定代表人:高国富
客户服务电话:95528
公司网址:www.spdb.com.cn
(2)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
法定代表人:洪崎
客户服务电话:95568
公司网址:www.cmbc.com.cn
(3)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
法定代表人:谢永林
客户服务电话:95511-3
公司网址:www.bank.pingan.com
(4)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
法定代表人:陈四清
客户服务电话:95566
公司网址:www.boc.cn
(5)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
法定代表人:王连志
客户服务电话:95517
公司网址:www.essence.com.cn
(6)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
客户服务电话:400-651-5988
公司网址:www.ewww.com.cn
(7)东北证券股份有限公司
办公地址:长春市生态大街6666号
法定代表人:李福春
客户服务电话:95360
公司网址:www.nesc.cn
(8)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
法定代表人:范力
客户服务电话:95330
公司网址:www.dwzq.com.cn
(9)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
客户服务电话:95525
公司网址:www.ebscn.com
(10)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
客户服务电话:400-818-8118
公司网址:www.guodu.com
(11)国海证券股份有限公司
办公地址:广西南宁市滨湖路46号
法定代表人:何春梅
客户服务电话:95563
公司网址:http://www.ghzq.com.cn
(12)国金证券股份有限公司
办公地址:成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
客户服务电话:95310
公司网址:www.gjzq.com.cn
(13)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
客户服务电话:95570
公司网址:http://www.glsc.com.cn
(14)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
客户服务电话:95521
公司网址:www.gtja.com
(15)国信证券股份有限公司
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人:何如
客户服务电话:95536
公司网址:www.guosen.com.cn
(16)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
客户服务电话: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
(17)恒泰证券股份有限公司
办公地址:呼和浩特市新城区海拉尔东街满世书香苑办公楼7楼
法定代表人:庞介民
客户服务电话:400-196-6188
公司网址:www.cnht.com.cn
(18)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
法定代表人:陈林
客户服务电话:400-820-9898
公司网址:www.cnhbstock.com
(19)华泰证券股份有限公司
办公地址:南京市江东中路288号
法定代表人:周易
客户服务电话:95597
公司网址:www.htsc.com.cn
(20)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
客户服务电话:95511-8
公司网址:www.stock.pingan.com
(21)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
客户服务电话:400-891-8918
公司网址:www.shzq.com
(22)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
法定代表人:李琦
客户服务电话:400-800-0562
公司网址:www.hysec.com
(23)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
法定代表人:李梅
客户服务电话:95523
公司网址:www.swhysc.com
(24)太平洋证券股份有限公司
办公地址:北京市西城区北展北街9号华远企业号D座三单元
法定代表人:李长伟
客户服务电话:95397
公司网址:www.tpyzq.com
(25)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
客户服务电话:95321
公司网址:www.cindasc.com
(26)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
客户服务电话:95562
公司网址:www.xyzq.com.cn
(27)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
法定代表人:丁益
客户服务电话:400-6666-888
公司网址:www.cgws.com
(28)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
法定代表人:李新华
客户服务电话:95579
公司网址:www.95579.com
(29)招商证券股份有限公司
办公地址:深圳市福田区福华一路111号招商证券大厦23楼
法定代表人:霍达
客户服务电话:95565
公司网址:www.newone.com.cn
(30)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
法定代表人:陈共炎
客户服务电话:4008-888-888或95551
公司网址:www.chinastock.com.cn
(31)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
客户服务电话:95532或400-600-8008
公司网址:www.china-invs.cn
(32)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
客户服务电话:95538
公司网址:www.zts.com.cn
(33)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
客户服务电话:95587
公司网址:www.csc108.com
(34)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
客户服务电话:400-990-8826
公司网址:www.citicsf.com
(35)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
法定代表人:姜晓林
客户服务电话:95548
公司网址:http://sd.citics.com/
(36)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
法定代表人:张佑君
客户服务电话:95548
公司网址:www.cs.ecitic.com
(37)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
法定代表人:宁敏
客户服务电话:4006208888
公司网址:www.bocichina.com
（38）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
客户服务电话:4001599288
公司网址:https://danjuanapp.com/
（39）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
（40）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
（41）上海华夏财富投资管理有限公司
客户电话:400-817-5666
（42）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
客户电话:400-820-5369
公司网址:www.jiyufund.com.cn
（43）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
（44）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
（45）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
（46）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
（47）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
（48）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/
(49)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
（50）腾安基金销售（深圳）有限公司
办公地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
公司网址:www.tenganxinxi.com
客户服务电话:95017
（51）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
（52）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
客户电话:4008-773-772
公司网址:www.5ifund.com
（53）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
（54）上海万得基金销售有限公司
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
公司网址:www.520fund.com.cn
（55）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
（56）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
客户电话:400-6099-200
公司网址:www.yixinfund.com
（57）奕丰基金销售有限公司
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
（58）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
客户电话:400-6262-818
公司网址:www.5irich.com
（59）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
（60）珠海盈米基金销售有限公司
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
（61）上海大智慧基金销售有限公司
办公地址:上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11层
客户电话:021-20219931
公司网址:https://8.gw.com.cn/
（62）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
客户电话:400-999-8800
公司网址:www.webank.com
（63）北京百度百盈基金销售有限公司
办公地址:北京市海淀区上地信息路甲9号奎科大厦
公司网址:www.baiyingfund.com
客户服务电话:95055
6.2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。

7 基金份额净值公告/基金收益公告的披露安排
自2019年3月5日起，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金销售机构以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。敬请投资者留意。

8 其他需要提示的事项
（1）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。投资者通过场外销售机构办理本基金的场外申购与赎回业务应遵守各代销机构的有关业务规则。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。
（2）由于各代销机构系统及业务安排等原因，可能开展上述业务的时间有所不同，投资者应以各代销机构具体规定的时间为准。
（3）本公告仅对本基金开放日常申购、赎回及定期定额投资业务的有关事项予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况，请仔细阅读2018年11月13日《证券时报》上的《华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金（LOF）招募说明书》。本基金《招募说明书》同时发布在本公司网站（www.fsfund.com）。
（4）投资者也可通过华宝基金管理有限公司网站（www.fsfund.com）和华宝基金管理有限公司客户服务电话（400-700-5588、021-38924558）咨询有关情况。
（5）上述业务的解释权归本基金管理人。
风险提示: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。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的《基金合同》和《招募说明书》。敬请投资者注意投资风险。
特此公告。

华宝基金管理有限公司
2019年2月28日

华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金（LOF）开通转托管业务的公告

为了保证基金份额持有人的利益，经华宝基金管理有限公司（以下简称"本基金管理人"）向上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司提出申请，将自2019年3月5日开通办理华宝标普中国A股质量价值指数证券投资基金（LOF）（以下简称"本基金"）（基金代码:501069，场内简称:质量基金）的系统内转托管和跨系统转托管业务。
投资者自2019年3月5日起可通过本基金的销售机构办理本基金跨系统转托管业务。跨系统转托管的具体业务按照上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。
本基金系统内转托管业务的办理规则以基金合同、招募说明书和销售机构的相关规定为准。
投资者可登陆本公司网站www.fsfund.com，或拨打本公司客服电话400-700-5588、021-38924558咨询相关信息。
风险提示: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。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的招募说明书。敬请投资者注意投资风险。
特此公告。

华宝基金管理有限公司
2019年2月28日