华宝中证消费龙头指数证券投资基金（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:中国民生银行股份有限公司
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:2020年1月6日
公告日期:2019年12月31日

一、重要声明与提示

《华宝中证消费龙头指数证券投资基金（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,华宝中证消费龙头指数证券投资基金（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。本基金托管人中国民生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中证消费龙头指数证券投资基金（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,请投资者阅读2019年9月27日发布在本公司网站和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）上的《华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）招募说明书》（以下简称“招募说明书”）、《华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）和《华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）托管协议》（以下简称“托管协议”）。

二、基金概览

（一）基金名称:华宝中证消费龙头指数证券投资基金（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12月27日,本基金的基金份额总额:288,580,786.84份
（五）基金份额净值:截至2019年12月27日,本基金份额净值:1.0001元
（六）本次上市交易的基金份额总额:35,010,899.00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:2020年1月6日
（九）基金管理人:华宝基金管理有限公司
（十）基金托管人:中国民生银行股份有限公司
（十一）上市推荐人:光大证券股份有限公司
（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【2019】654号
2.基金合同生效日:2019年12月19日
3.发售日期:2019年10月8日起至2019年12月16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
平安银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、安信证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、大同证券有限责任公司、第一创业证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、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、开源证券股份有限公司、联储证券有限责任公司、民生证券股份有限公司、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、西藏东方财富证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、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、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、上海联泰基金销售有限公司、诺亚正行基金销售有限公司、上海天相投资顾问有限公司、上海长量基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、上海陆金所基金销售有限公司、深圳市前海排排网基金销售有限公司、上海利升投资管理有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、上海挖财基金销售有限公司、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、上海陆金所基金销售有限公司、深圳众禄基金销售股份有限公司、珠海盈米基金销售管理有限公司、北京汇成基金销售有限公司、通华财富(上海)基金销售有限公司、北京肯特瑞基金销售有限公司、北京百度百盈基金销售有限公司。
7.验资机构名称:安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
8.募集资金已缴及入账情况
本次募集的有效净认购金额为288,441,220.43元人民币,折合基金份额288,441,220.43份;利息结转份额139,566.41份,总确认份额为288,580,786.84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12月18日全额划入本基金在基金托管人中国民生银行股份有限公司开立的华宝中证消费龙头指数证券投资基金（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,本次募集资金折合基金份额共计288,580,786.84份,其中本场内认购的基金份额（本息）确认为35,010,899.00份,场外认购的基金份额（本息）确认为253,569,887.84份。
9.本基金募集备案情况
本基金于2019年12月18日验资完毕,2019年12月19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12月19日获得《关于华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）备案确认的函》（机构部函【2019】3095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12月19日
11.基金合同生效日的基金份额总额:288,580,786.84份
（二）本基金日常申购、赎回情况
本基金将于2020年1月6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12月31日《中国证券报》及发布在本公司网站和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）上的《华宝中证消费龙头指数证券投资基金（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]308号
2.上市交易日期:2020年1月6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:消费龙头(基金代码:501090)
5.本次上市交易份额:35,010,899.00份（截至2019年12月27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12月27日,本基金基金份额持有人总户数为5,211户,其中场内份额持有人户数为581户,平均每户持有的场内基金份额为60,259.72份;场外份额持有人户数为4,630户,平均每户持有的场外基金份额为54,766.71份。
（二）持有人结构
1.截至2019年12月27日,场内基金份额持有人结构如下:
截至2019年12月27日,本基金场内投资者持有基金份额35,010,899.00份。其中,场内机构投资者持有的基金份额为99,291.00份,占基金场内总份额的0.28%;场内个人投资者持有的基金份额为34,911,608.00份,占基金场内总份额的99.72%。
2.截至2019年12月27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	0.00	0.00

（三）截至2019年12月27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	王琪	995,879.00	2.84%
2	王艳	995,879.00	2.84%
3	贺小龙	995,879.00	2.84%
4	万安	995,024.00	2.84%
5	于宏伟	878,220.00	2.51%
6	王忠炳	793,722.00	2.27%
7	邵飞舸	724,206.00	2.07%
8	周宝妤	644,841.00	1.84%
9	刘淑凤	595,670.00	1.70%
10	董玉华	496,458.00	1.42%

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15亿元
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:310000400034472
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，LP.持有49%的股份。
2.内部组织结构及职能
公司下设30个部门,包括:研究部、国内投资部、机构投资部、国际业务部、量化投资部、固定收益部、多元资产管理部、养老金部、产品开发部、北京分公司、深圳分公司、北方机构销售部、华东机构销售部、营销中心（西部、北方、东部、南方）、互金展业部、互金策划部、营销管理部、客户服务部、专户营销部、战略规划部、交易部、清算登记部、信息技术部、人力资源部、综合管理部、财务部、合规审计部、风险管理部。
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ODII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产品,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;基金等资管产品研究;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、企业年金的发展战略与规划、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:负责分公司的行政及后勤管理。
深圳分公司:负责南方地区机构客户的开发和维护工作。
北方机构销售部:负责北京及周边地区机构客户的开发和维护工作。
华东机构销售部:负责上海及周边地区机构客户的开发和维护工作。
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:负责互联网金融商务拓展;互联网金融运维统筹;互联网金融直销展业。
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;公司企宣。
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:负责按受基金经理下达的投资指令,在确认投资指令的有效性后加以执行;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证券投资、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,定期公布相关财务会计报表和会计报告;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;负责公司内部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。
合规审计部:根据公司业务发展,负责公司内控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需办内容的报送,负责公司各类法律事务、反洗钱事务,落实公司风险控制委员会相关合规管理的决议,根据公司管理层的指示,就公司合规和内控工作与公司内外部相关机构的协调、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相关风险管理的决议，根据公司管理层的指示，负责就公司的风险管理工作与公司内外部相关机构的协调、沟通。
信息披露负责人:HUANG Xiaoyi Helen（黄小薏）;021-38505888
截至2019年12月15日,我公司共有员工263人,其中博士及博士以上有7人,硕士157人,本科92人,专科及以下7人。
3.基金管理业务情况
截至2019年6月30日，华宝基金管理有限公司旗下共管理71只开放式基金，资产管理规模为171,851,775,826.03元。旗下管理的基金有宝康系列基金、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、华宝商外中国成长基金、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、华宝宝丰高等级债券基金、华宝绿色主题基金、华宝沪港深价值基金、华宝质量基金、华宝科技先锋基金、华宝车联网基金、华宝中短债债券基金、华宝大健康基金、华宝稳健养老FOF基金、华宝宝盛债券基金、华宝宝怡债券基金、华宝中证医疗ETF、华宝消费升级基金。
4.本基金基金经理
胡洁,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,2019年5月起任华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2019年7月起任华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2019年8月起任华宝MSCI中国A股国际通ESG通用指数证券投资基金（LOF）,华宝中证科技龙头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。
（二）基金托管人
一)基金托管人概况
1.基本情况
名称:中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）
住所:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:洪崎
成立时间:1996年2月7日
基金托管业务批准文号:证监基金字[2004]101号
组织形式:其他股份有限公司（上市）
注册资本:28,365,585,227元人民币
存续期间:持续经营
电话:010-58560666
联系人:罗菲菲
中国民生银行是我国首家主要由非公有制企业入股的全国性股份制商业银行,同时又是严格按照《公司法》和《商业银行法》建立的规范的股份制金融企业。多种经济成份在中国金融业的涉足和实现规范的现代企业制度,使中国民生银行有别于国有银行和其他商业银行,而为国内外经济界、金融界所关注。中国民生银行成立二十年来,业务不断拓展,规模不断扩大,效益逐年递增,并保持了快速健康的发展势头。
2000年12月19日,中国民生银行A股股票（600016）在上海证券交易所挂牌上市。 2003年3月18日,中国民生银行40亿可转换公司债券在上交所正式挂牌交易。2004年11月8日,中国民生银行通过银行间债券市场成功发行了58亿元人民币次级债券，成为中国第一家在全国银行间债券市场成功私募发行次级债券的商业银行。2005年10月26日,民生银行成功完成股权分置改革,成为国内首家完成股权分置改革的商业银行,为中国资本市场股权分置改革提供了成功范例。 2009年11月26日,中国民生银行在香港交易所挂牌上市。
中国民生银行自上市以来,按照“团结奋进,开拓创新,培育人才;严格管理,规范行为,敬业守法;讲究质量,提高效益,健康发展”的经营发展方针,在改革发展与管理等方面进行了有益探索,先后推出了“大集中”科技平台、“两率”考核机制、“三卡”工程、独立评审制度、八大基础管理系统、集中处理商业模式及事业部改革等制度创新,实现了低风险、快增长、高效益的战略目标,树立了充满生机与活力的崭新的商业银行形象。
民生银行荣获第十三届上市公司董事会“金圆桌”优秀董事会奖;
民生银行在华夏时报社主办的第十一届金蝉奖评选中荣获“2017年度小微金融服务银行”;
民生银行荣获《亚洲货币》杂志颁发的“2016中国地区最佳财富管理私人银行”奖项;
民生银行荣获新浪财经颁发的“年度最佳电子银行”及“年度直销银行十强”奖项;
民生银行荣获 VISA 颁发的“最佳产品设计创新奖”;
民生银行在经济观察报举办的“中国卓越金融奖”评选中荣获“年度卓越资产管理银行”;
民生银行荣获全国银行间同业拆借中心授予的 “2016年度银行间本币市场优秀交易商”、“2016年度银行同本币市场优秀衍生品交易商”及“2016年度银行间本币市场优秀债券交易商”奖项;
民生银行荣获中国银行间交易协商会授予的“2016年度优秀综合做市机构”和“2016年度优秀信用债做市商”奖项;
民生银行荣获英国WPR（全球最大的传媒集团之一）颁发的“2017 年度最具价值中国品牌100强”;
民生银行在中国资产证券化论坛年会上被授予“2016年度特殊贡献奖”。
2.主要人员情况
张庆先生,中国民生银行资产托管部总经理,博士研究生,具有基金托管人高级管理人员任职资格,从事过金融租赁、证券投资、银行管理等工作,具有25年金融从业经历,不仅有丰富的一线实战经验,还有扎实的总部管理经历。历任中国民生银行西安分行副行长,中国民生银行沈阳分行筹备组组长、行长、党委书记。
3.基金托管业务经营情况
中国民生银行股份有限公司于2004年7月9日获得基金托管资格，成为《中华人民共和国证券投资基金法》颁布后首家获批从事基金托管业务的银行。为了更好地发挥后发优势,大力发展托管业务,中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立伊始就本着充分保护基金持有人的利益、为客户提供高品质托管服务的原则,高起点地建立系统、完善制度、组织人员。资产托管部目前共有员工71人,平均年龄37岁,100%员工拥有大学本科以上学历,62.5%以上员工具有硕士以上文凭。
中国民生银行坚持以客户需求为导向,秉承“诚信、严谨、高效、务实”的经营理念,依托丰富的资产托管经验、专业的托管业务服务和先进的托管业务平台,为境内外客户提供安全、准确、及时、高效的专业托管服务。截至2019年3月31日,中国民生银行已托管182只证券投资基金。中国民生银行资产托管部于2018年2月6日发布了“爱托管”品牌,近百余家资管机构及合作客户的代表受邀参加了启动仪式。资产托管部始终坚持以客户为中心,致力于为客户提供全面的综合金融服务。对内大力整合行内资源,对外广泛搭建客户服务平台,向各类托管客户提供专业化、增值化的托管综合金融服务,得到各界的充分认可,也在市场上树立了良好品牌形象,成为市场上一家有特色的托管银行。自2010年至今,中国民生银行荣获《金融理财》杂志颁发的“最具潜力托管银行”、“最佳创新托管银行”、“金牌创新力托管银行”奖和“年度金牌托管银行”奖,荣获《21世纪经济报道》颁发的“最佳金融服务托管银行”奖。
二)基金托管人的内部控制制度
1.内部风险控制目标
(1)建立完整、严密、高效的风险控制体系,形成科学的决策机制、执行机制和监督机制,防范和化解经营风险,保障资产托管业务的稳健运行和托管财产的安全完整。
(2)大力培育合规文化,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念,严格控制合规风险,保证资产托管业务符合国家有关法律法规和行业监管规则。
(3)以相互制衡健全有效的风控组织结构为保障,以完善健全的制度为基础,以落实到位的过程控制为着眼点,以先进的信息技术手段为依托,建立全面、系统、动态、主动、有利于差错防弊、堵塞漏洞、消除隐患、保证业务稳健运行的风险控制制度,确保托管业务信息真实、准确、完整、及时。
2.内部风险控制组织结构
总行高级管理层负责部署和实施公司的风险管理工作。总行风险管理委员会是总行高级管理层下设的风险管理专业委员会,对高级管理层负责,支持高级管理层履行职责。资产托管业务风险控制工作在总行风险管理委员会的统一部署和指导下开展。
总行各部门紧密配合,共同把控资产托管业务运行中的风险,具体职责与分工如下:总行风险管理与质量监控部作为总行风险管理委员会秘书机构,是全行风险管理的统筹部门,对资产托管部的风险控制工作进行指导;总行法律合规部负责资产托管业务项下的相关合同,协议等文本的审定,负责该业务与管理的合规性审查,检查与督导整改;总行审计部对全行托管业务进行内部审计。包括定期内部审计、现场和非现场检查等;总行办公室（品牌管理中心）与资产托管部共同制定声誉风险应对预案。按资产托管部需求对由托管业务引发的声誉风险事件进行定向舆情监测,对由托管业务引起的声誉风险进行应急处置,包括与全国性媒体进行沟通、避免负面报道、组织正面回应等。
3.内部风险控制原则
(1)合法合规原则。风险控制应符合和体现国家法律、法规、规章和各项政策。
(2)全面性原则。风险控制覆盖托管部的各个业务中心、各个岗位和各级人员,并涵盖资产托管业务各环节。
(3)有效性原则。资产托管业务从业人员应全力维护内部控制制度的有效执行,任何人都没有超越制度约束的权力。
(4)预防性原则。必须树立“预防为主”的管理理念,控制资产托管业务中风险发生的源头,防患于未然,尽量避免业务操作中各种问题的产生。
(5)及时性原则。资产托管业务风险控制制度的制定应当具有前瞻性,并且随着托管理经营战略、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进行及时的修改或完善。发现问题,要及时处理,堵塞漏洞。
(6)独立性原则。各业务中心、各岗位职能上保持相对独立性。风险监督中心是资产托管部下设的执行机构,不受其他业务中心和个人干涉。业务操作人员和检查人员严格分开,以保证风险控制机构的工作不受干扰。
(7)相互制约原则。各业务中心、各岗位权责明确,相互牵制,通过切实可行的相互制衡措施来消除风险控制的盲点。
(8)防火墙原则。托管银行自身财务与托管资产财务严格分开;托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门隔离。
4.内部风险控制制度和措施
(1)制度建设: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。
(2)建立健全的组织管理结构:前后台分离,不同部门、岗位相互牵制。
(3)风险识别与评估:风险监督中心指导业务中心进行风险识别、评估,制定并实施风险控制措施。
(4)相对独立的业务操作空间:业务操作区相对独立,实施门禁管理和音像监控。
(5)人员管理:进行定期的业务与职业道德培训,使员工树立风险防范与控制理念,并签订承诺书。
(6)应急预案:制定完备的《应急预案》,并组织员工定期演练;建立异地灾备中心,保证业务不中断。
5.资产托管部内部风险控制
中国民生银行股份有限公司从控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、监控等五个方面构建了托管业务风险控制体系。
(1)坚持风险管理与业务发展同等重要的理念。托管业务是商业银行新兴的中间业务,中国民生银行股份有限公司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,中国民生银行股份有限公司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。
(2)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。中国民生银行股份有限公司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中心和业务岗位,每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。
(3)建立分工明确、相互牵制的风险控制组织结构。托管部通过建立纵向双人制、横向多中心制的内部组织结构,形成不同中心、不同岗位相互制衡的组织结构。
(4)以制度建设作为风险管理的核心。中国民生银行股份有限公司资产托管部一分里视内部控制制度的建设,已经建立了一整套内部风险控制制度,包括业务管理办法、内部控制制度、员工行为规范、岗位职责及涵括所有后台运作环节的操作手册。以上制度随着外部环境和业务的发展还会不断增加和完善。
(5)制度的执行和监督是风险控制的关键。制度执行比编写制度更重要,制度落实检查是风险控制管理的有力保证。中国民生银行股份有限公司资产托管部内部设置专职风险监督中心,依照有关法律规章,定期对业务的运行进行稽核检查。总行审计部也不定期对资产托管部进行稽核检查。
(6)将先进的技术手段运用于风险控制中。在风险管理中,技术控制风险比制度控制风险更加可靠,可将人为不确定因素降至最低。托管业务统需求不仅从业务方面而且从风险控制方面都要经过多方论证,托管业务技术系统具有较强的自动风险控制功能。
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
根据《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规的规定,对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例,基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购赎金的到账和赎回资金的划付,基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。
基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关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确认并以书面形式对基金托管人发出回函。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。
（三）验资机构
名称:安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
法定代表人:毛鞍宁
电话:010-58153000
传真:010-85188298
联系人:徐艳
经办注册会计师:徐艳、印艳萍

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,其他各基金销售机构根据本基金招募说明书规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12月27日的资产负债表如下:

资产	本报告期末
	2019年12月27日
资产:	
银行存款	188,597,943.56
结算备付金	-
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	100,000,000.00
应收证券清算款	-
应收利息	78,022.00
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	-
资产总计	288,675,965.56
	本报告期末
负债和所有者权益	
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	47,438.62
应付托管费	6,325.16
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	23,459.03
负债合计	77,222.81
所有者权益:	
实收基金	288,580,786.84
未分配利润	17,955.91
所有者权益合计	288,598,742.75
负债和所有者权益总计	288,675,965.56

注:截至2019年12月27日,基金份额净值1.0001元,基金份额总额288,675,965.56份。

八、基金投资组合

截至2019年12月27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	100,000,000.00	34.64
	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	188,597,943.56	65.33
7	其他资产	78,022.00	0.03
8	合计	288,675,965.56	100

（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12月27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12月27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
截至2019年12月27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十名股票投资明细
截至2019年12月27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12月27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12月27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12月27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12月27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12月27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12月27日,本基金未持有股票。
2.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	78,022.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	78,022.00

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12月27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12月27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12月27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12月19日正式生效,基金管理人已于2019年12月20日在《中国证券报》刊登《华宝中证消费龙头指数证券投资基金（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,按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）在知悉可能对基金份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、