华宝兴业上证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

2016年第2号

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司
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《华宝兴业上证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2016年10月23日，有关财务数据和净值表现截止日为2016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：华宝兴业基金管理有限公司
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：郑安国
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
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

郑安国先生，董事长，博士、高级经济师。曾任南方证券有限公司发行部经理、投资部经理、南方证券有限公司投资银行部总经理助理、南方证券有限公司上海分公司副总经理、南方证券公司研究所总经理级副所长、华宝信托投资有限责任公司副总经理、总经理、总裁、董事长，华宝投资有限公司董事、总经理。现任华宝兴业基金管理有限公司董事长，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月加入华宝兴业基金管理有限公司，曾任公司营运总监、董事会秘书、副总经理，现任公司总经理。

Lionel PAQUIN先生，董事，硕士。曾在法国财政部、法国兴业银行、领先资产管理有限公司从事监察、风险管理和专户平台等业务，现任领先资产管理有限公司总裁。

Alexandre Werno先生，董事，硕士。曾在法兴集团从事内审监察及国际业务战略风险管理工作；曾任法国兴业银行全球市场执行董事、中国业务发展负责人。2013年5月加入华宝兴业基金管理公司任总经理高级顾问。现任公司常务副总经理。

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。现任华彬国际投资（集团）有限公司高级顾问。

2、监事会成员

Anne MARION-BOUCHACOURT女士，监事，硕士。曾任普华永道总监，杰米尼咨询金融机构业务副总裁，索尔文国际副总裁，法兴集团人力资源高级执行副总裁兼执行委员会委员。现任法兴集团中国区负责人，集团管理委员会委员。

欧江洪先生，监事，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。现任华宝投资有限公司总经理助理。

贺桂先先生，监事，毕业于江西财经大学。曾任华宝信托投资有限责任公司研究部副总经理。现任华宝兴业基金管理有限公司营运副总监。

3、高级管理人员

郑安国先生，董事长，简历同上。

HUANG Xiaoyi Helen（黄小薏）女士，总经理，简历同上。

Alexandre Werno先生，常务副总经理，简历同上。

任志强先生，副总经理，硕士。曾任南方证券有限公司上海分公司研究部总经理助理、南方证券研究所综合管理部副经理，华宝信托投资责任有限公司发展研究中心总经理兼投资管理部总经理、华宝信托投资责任有限公司总裁助理兼董事会秘书，华宝证券经纪有限公司董事、副总经理。2007年8月加入华宝兴业基金管理有限公司，曾任华宝兴业行业精选混合型证券投资基金基金经理。现任华宝兴业基金管理有限公司副总经理兼投资总监。

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年加入华宝兴业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。现任华宝兴业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年加入华宝兴业基金管理有限公司，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月任华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证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月任华宝兴业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。

5、权益投资决策委员会成员

任志强先生，副总经理、投资总监。

刘自强先生，投资副总监、华宝兴业动力组合混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业高端制造股票型证券投资基金基金经理、华宝兴业国策导向混合型证券投资基金基金经理。

闫旭女士，助理投资总监、国内投资部总经理、华宝兴业行业精选混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业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、华宝兴业宝康消费品证券投资基金基金经理、华宝兴业品质生活股票型证券投资基金基金经理、华宝兴业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。

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：洪渊

（二）主要人员情况

截至2016年9月末，中国工商银行资产托管部共有员工210人，平均年龄30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、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2016年9月，中国工商银行共托管证券投资基金624只。自2003 年以来，本行连续十一年获得香港《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51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、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：郑安国
直销柜台电话：021-38505731、38505732、021-38505888-301或302
直销柜台传真：021-50499663、50938055

（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）中国建设银行股份有限公司
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：王洪章
客户服务电话：95533
网址：www.ccb.com

（2）中国银行股份有限公司
住所：北京市复兴门内大街1号
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：田国立
客户服务电话：95566
网址：www.boc.cn

（3）中国农业银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人：蒋超良
客户服务电话：95599
网址：www.95599.cn

（4）交通银行股份有限公司
注册地址：上海市银城中路188号
办公地址：上海市银城中路188号
法定代表人：牛锡明
电话：（021）58781234
传真：（021）58408483
联系人：曹榕
客户服务电话：95559
网址：www.bankcomm.com

（5）招商银行股份有限公司
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人：李建红
联系人：邓炯鹏
联系电话：0755－83198888
公司网址：www.cmbchina.com
客户服务电话：95555

（6）中国民生银行股份有限公司
注册地址：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
联系电话：010-58560666
传真：010-57092611
联系人：杨成茜
客户服务电话：95568
公司网址：www.cmbc.com.cn

（7）中信银行股份有限公司
法定代表人：常振明
注册地址：北京市东城区朝阳门北大街9号
24小时客户服务热线：95558
网址：bank.ecitic.com

（8）平安银行股份有限公司
地址：深圳市深南东路5047号
法定代表人：孙建一
联系人：张莉
联系电话：021-38637673
传真电话：021-50979507
客户服务电话：95511-3
公司网址：bank.pingan.com

（9）上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：中国?上海市中山东一路12号
法定代表人：吉晓辉
联系人：高天、姚磊
电话：021-61618888
传真：021－63604196
客户服务热线：95528
公司网址：www.spdb.com.cn

（10）中国工商银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
客户服务电话：95588
网址：www.icbc.com.cn

（11）兴业银行股份有限公司
注册地址：福州市湖东路154号中山大厦
法定代表人：高建平
网址：http://www.cib.com.cn
客户服务电话：95561 或拨打各城市营业网点咨询电话

（12）江苏银行股份有限公司
住所：南京市洪武北路55号
法定代表人：黄志伟
网址：www.jsbchina.cn
客户服务电话：96098，40086-96098

（13）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
法定代表人：李伏安
网址：www.cbhb.com.cn
客户服务电话：95541

（14）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
法定代表人：吴建
客户服务电话：95577
网址：www.hxb.com.cn

（15）国泰君安证券股份有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
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
客服电话：95521
网址：www.gtja.com

（16）光大证券股份有限公司
注册地址：上海市静安区新闸路1508 号
办公地址：上海市静安区新闸路1508 号
法定代表人：薛峰
联系人：刘晨、李芳芳
电话：021－22169999
传真：021－22169134
客户服务热线：95525、4008888788、10108998
公司网址：www.ebscn.com

（17）海通证券股份有限公司
注册地址：上海淮海中路98号
法定代表人：王开国
电话：021－23219000
服务热线：95553、400－8888－001或拨打各城市营业网点咨询电话
联系人：李笑鸣
公司网址：www.htsec.com

(18) 华泰证券股份有限公司
注册地址：南京市江东中路228号
法定代表人：吴万善
电话：0755－82492193
传真：0755－82492962
联系人：庞晓芸
公司网址：www.htsc.com.cn
客户服务热线：95597

(19) 申万宏源证券有限公司
注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层（邮编：200031）
法定代表人：李梅
电话：021-33389888
传真：021-33388224
客服电话：95523或4008895523
电话委托：021-962505
国际互联网网址：www.swhysc.com
联系人：黄莹

（20）中信证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期北座）
法定代表人：王东明
电话：010-60838888
传真：010-60833739
联系人：顾凌
客户服务电话：95548
公司网址：www.cs.ecitic.com

（21）国信证券股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16楼至26楼
法定代表人：何如
联系人：周杨
电话：0755－82130833
传真：0755-82133952
客户服务热线：95536
国信证券网站：www.guosen.com.cn

（22）中信证券（山东）有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人：杨宝林
基金业务联系人：吴忠超
电话：0532-85022326
传真：0532-85022605
客户咨询电话：95548
公司网址：www.citicssd.com

（23）广发银行股份有限公司
注册地址：广东省广州市农林下路 83 号
办公地址：广东省广州市农林下路 83 号
法定代表人：李若虹
客户服务电话：800-830-8003；400-830-8003
网址：www.gdb.com.cn

（24）中国国际金融股份有限公司
住所：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：金立群
基金代销业务联系人：罗春蓉 、陈曦、康楠?
联系电话：010-65051166
传真：010-65058065
客户服务电话：400-910-1166

(25)民生证券有限责任公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层
办公地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层
法定代表人：余政
联系人：赵明
联系电话：010-85127622
联系传真：010-85127917
网址：www.mszq.com
客户服务电话：4006198888

（26）中泰证券股份有限公司
注册地址：山东省济南市市中区经七路86号
办公地址：山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人：李玮
联系人：吴阳
电话：0531-68889155
传真：0531-68889752
客服电话：95538
网址：www.zts.com.cn

（27）东兴证券股份有限公司
公司名称：东兴证券股份有限公司
住所：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
基金销售联系人：汤漫川
电话：010-66555316
传真：010-66555246
公司网站：www.dxzq.net.cn
公司客户服务电话：400-8888-993

（28）东北证券股份有限公司
注册地址：长春市自由大路1138号
办公地址：长春市自由大路1138号
法定代表人：李福春
电话：0431-85096517
传真：0431-85096795
客服电话：4006000686
网址：www.nesc.cn

（29）东海证券股份有限公司
注册地址：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
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
电话：021-20333333
传真：021-50498825
联系人：王一彦
客服电话：95531；400-8888-588
网址：www.longone.com.cn

（30）中航证券有限公司
注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
法定代表人：王宜四
联系人：戴蕾
联系电话：0791-86768681
客服电话：400-8866-567
公司网址：www.avicsec.com

（31）山西证券股份有限公司
注册地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
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
联系人：郭熠
联系电话：0351－8686659
传真：0351－8686619
客户服务电话：400-666-1618，95573
公司网址：www.i618.com.cn

(32)申万宏源西部证券有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
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：韩志谦
电话：0991-2307105
传真：0991-2301927
客户服务电话：400-800-0562
网址：www.hysec.com
联系人：王怀春

(33) 中信期货有限公司
注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
法定代表人：张皓
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
电话：0755-23953913
传真：0755-83217421
客户服务电话：400-990-8826
网址：www.citicsf.com

（34）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
法定代表人：杨文斌
电话：021-58370011
传真：021-68596919
客服热线：400-700-9665
好买基金交易网：www.ehowbuy.com

（35）深圳众禄金融控股股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人：薛峰
电　　话：0755-33227950
传　　真：0755-33227951
公司网址：www.zlfund.cn www.jjmmw.com
客服热线：4006-788-887

（36）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
法定代表人：陈柏青
电话：021-60897840
传真：0571-26698533
客服热线：4000-766-123
公司网址：http://www.fund123.cn/

（37）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
法定代表人：其实
电话：021-54509998
传真：021-64385308
客户服务电话：400-1818-188
公司网址：www.1234567.com.cn

（38）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
法定代表人：王莉
电话：021-20835788
传真：021-20835879
客户服务电话：400-920-0022
公司网址：licaike.hexun.com

（39）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006
法定代表人：杨懿
电??? 话：010-83363099
传??? 真：010-83363010
客户服务电话：400-166-1188
网址：http://8.jrj.com.cn

（40）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址：上海杨浦区秦皇岛路32号C栋 2楼
法定代表人：汪静波
联系人：方成
联系电话：021-38609777
公司网址：www.noah-fund.com
客户服务电话：400－821－5399

（41）深圳腾元基金销售有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806-1810
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
业务联系人：廖萌莎
联系电话：0755-33376922
公司网址：www.tenyuanfund.com
客户服务电话：4006-877-899

（42）浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
法定代表人：凌顺平
电话：0571-88911818
传真：0571-86800423
网址：www.5ifund.com
客服：4008-773-772

（43）宜信普泽投资顾问（北京）有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
法人名称：沈伟桦
销售网站：www.yixinfund.com
客服电话：? 400-6099-200

（44）中经北证（北京）资产管理有限公司
注册地址：北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
法人代表名称：徐福星
办公地址：北京市西城区车公庄大街4号1号楼1层
电话：010-68998820
传真：010-88381550
网站：www.bzfunds.com
客服电话：400-600-0030

（45）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
法人代表：鲍东华
电话：021-20665952
传真：021-22066653
公司网站：www.lufunds.com
客户服务电话： 4008219031

（46）上海联泰资产管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层
法定代表人：燕斌
电　　话：021-52822063
传　　真：021-52975270
客户服务电话：4000-466-788
网站：www.66zichan.com

（47）上海万得投资顾问有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
法定代表人：王廷富
电　　话：021-51327185
传　　真：021-6888 2281
客服电话：400-821-0203

（48）珠海盈米财富管理有限公司
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
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
法人代表：肖雯
电话：020-89629099
传真：020-89629011
客服电话：020-89629066
网址：www.yingmi.cn

（49）北京新浪仓石基金销售有限公司
注册地址：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
法定代表人：李昭琛
注册资本：2000万元
电话：010-62675369
传真：010-62675979
客服电话：010-62675369
公司网址：www.xincai.com

（50）北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
注册资本：2000万元
法定代表人：陈超
公司网址：http://kenterui.jd.com
电　　话：4000988511/ 4000888816

基金管理人可根据有关法律法规，选择其它符合要求的机构代理发售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

华宝兴业基金管理有限公司
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：郑安国
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：华宝兴业上证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，或用作杆杠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、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。

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2016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	1,187,211.00	0.94
	其中：股票	1,187,211.00	0.94
2	基金投资	116,445,433.96	92.16
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	8,695,336.04	6.88
8	其他资产	26,186.62	0.02
9	合计	126,354,167.62	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	49,582.00	0.04
C	制造业	96,406.00	0.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	88,472.00	0.07
E	建筑业	57,329.00	0.05
F	批发和零售业	4,112.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	37,878.00	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,280.00	0.01
J	金融业	769,039.00	0.62
K	房地产业	71,113.00	0.06
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	1,187,211.00	0.96

(2)报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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	3,600	122,976.00	0.10
2	600016	民生银行	8,800	81,488.00	0.07
3	601166	兴业银行	5,000	79,850.00	0.06
4	600036	招商银行	3,900	70,200.00	0.06
5	601328	交通银行	10,300	56,959.00	0.05
6	600000	浦发银行	3,200	52,768.00	0.04
7	600900	长江电力	3,400	45,220.00	0.04
8	601288	农业银行	14,200	44,446.00	0.04
9	601169	北京银行	4,500	40,950.00	0.03
10	601398	工商银行	9,000	39,870.00	0.03

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	华宝兴业基金管理有限公司	116,445,433.96	93.64

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

本基金本投资股指期货。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金本投资股指期货。

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

本基金本投资国债期货。

（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本投资国债期货。

（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2016年9月30日持仓前十名证券中的招商银