

# 上证180成长交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)摘要

2017年1月1号

基金管理人: 华宝兴业基金管理有限公司  
基金托管人: 中国银行股份有限公司

重要提示  
 上证180成长交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会2011年4月7日证监许可[2011]496号文核准募集。

基金管理人保证《上证180成长交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》(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,由于基金投资组合连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金投资管理过程中产生的基金管理风险,本基金的特有风险等。本基金为股票基金,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。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现,基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险,投资人认(或申购)基金时,请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。

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资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。  
 本基金要依据基金合同和基金招募说明书约定,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。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,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。基金投资人购买基金份额即成为基金份额持有人,应详细阅读基金合同。

本招募说明书摘要所载内容截止日为2017年2月4日,有关财务数据和净值表现截止日为2016年12月31日,财务数据未经审计。

## 一、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60楼  
 法定代表人: 郑安国  
 总经理: HUANG Xiaoyi Helen (黄小慧)  
 成立日期: 2003年3月7日  
 注册资本: 1.5亿元人民币  
 电话: 021-38505888  
 联系人: 袁希

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40%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, 华宝信托有限责任公司副总经理、总经理、总裁, 董事长, 华宝兴业基金管理有限公司董事、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 (黄小慧) 女士, 董事, 硕士。曾任加拿大TD Securities公司金融分析师, Aetion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。现任公司副总经理。  
 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、风险管理和专户柜台等业务, 现任领先资产管理有限公司总裁。  
 Alexandre Werno先生, 董事, 硕士。曾在法国集兴集团从事内审监察及国际业务战略风险管理等工作; 曾任法国兴业银行全球市场发行董事、中国业务发展负责人。2013年5月加入华宝兴业基金管理有限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曼律师事务所律师, 利浦电子中国集团法律顾问, 上海市君信律师事务所合伙人。现任上海胡光律师事务所主任、首席合伙人。  
 郑安宇先生, 独立董事, 博士。曾任宁夏广播电视台主讲师, 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, 荷兰合作银行东亚地区食品农业研究主管, 新希望集团常务副总, 比利时普道银行中国区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。曾任普华永道监、杰米尼咨询金融机构业务副总监, 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。现任华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, 宝钢集团办公室秘书室主任。现任华宝投资有限公司总经理助理。  
 贺桂生先生, 监事, 本科。曾任华宝信托投资有限公司研究部副经理。现任公司营运副总监。  
 3、高级管理人员  
 郑安国先生, 董事长, 简历同上。  
 HUANG Xiaoyi Helen (黄小慧) 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副经理, 华宝信托投资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  
 胡洁女士, 金融学硕士, 量化投资部总经理助理。2006年6月加入华宝兴业基金管理有限公司, 先后在交易部、产品开发部工作, 担任量化投资部高级数量分析师兼任投资经理助理的职务。2012年10月起任上证180成长交易型开放式指数证券投资基金-华宝兴上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015年5月21日起任华宝兴中证医药分级指数证券投资基金基金经理。2015年6月4日起任华宝兴中证1000指数分级证券投资基金基金经理。2016年8月起任华宝兴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月起任华宝兴业标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)基金经理。华宝兴上证180成长交易型开放式指数证券投资基金的历史基金经理为余燕女士, 任职时间为2011年8月至2012年10月。  
 5、投资决策委员会成员  
 任志强先生, 副总经理、投资总监。  
 刘向辉先生, 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、华宝兴高端制造股票型证券投资基金基金经理、华宝兴国策导向混合型证券投资基金、华宝兴业未来主导产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。  
 周旭女士, 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。  
 胡文游先生, 助理投资总监, 华宝兴宝康消费品证券投资基金基金经理、华宝兴宝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。  
 曹蒙先生, 研究部总经理。  
 (三)基金管理人内部控制制度  
 1、风险管理体系  
 本系列基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规性风险、信息风险和事件风险(如灾难)。  
 针对上述各种风险, 本公司建立了一套完整的风险管理体系, 具体包括以下内容:  
 (1) 构建风险管理环境, 具体包括制定风险管理战略、目标, 设置相应的组织机构, 建立清晰的责任线路和报告渠道, 配备适当的人力资源, 开发适用的技术支持系统等内容。  
 (2) 识别风险。识别风险和基金管理中存在的风险。  
 (3) 分析风险。检查存在的控制措施, 分析风险发生的可能性及其引起的后果并将风险分类。  
 (4) 度量风险。评估风险水平的高低, 既有定性的度量手段, 也有定量的度量手段。定性的度量是把风险水平划分为若干等级, 每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别归入相应的级别。定量的方法则是设计一些风险指标, 测量其数值的的大小。  
 (5) 处理风险。将风险水平与既定的标准相对比, 对于那些级别较低, 在公司所定标准范围以内的风险, 控制相对宽松一点, 但仍予以定期监控, 以防其超过预定标准; 而对较为严重的风险, 则制定适当的风险控制措施; 对于一些后果可能极其严重的风险, 则除了严格控制以外, 还准备了相应的应急处理措施。  
 (6) 监测与检查。对已有的风险管理系统进行实时监控, 并定期评价其管理绩效, 在必要时结合新的需求加以改变。  
 (7) 报告与沟通。建立风险管理的报告系统, 使公司股东、公司董事会、公司高级管理人员及监管部门及时而有效地了解公司风险管理状况, 并寻求指导意见。  
 2、内部风险控制制度  
 (1) 内部控制组织原则  
 健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门和各级岗位, 并渗透到决策、执行、监督、反馈各个环节;  
 有效性原则。通过设置科学清晰的流程, 结合程序控制, 建立合理的内控程序, 维护内控制度的有效执行;  
 独立性原则。公司必须将精简化、科学化的基础上设立能充分满足公司经

营运作需要的部门和岗位, 各部门和岗位在职能上保持相对独立性; 公司固有财产、各项委托基金财产、其他资产分离运作, 独立进行;  
 相互制约原则。内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制约, 并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点;  
 防火墙原则。公司基金、管理、交易、清算登记、信息、技术、研究、市场营销等相关人员, 应当在职理上和制度上适当隔离, 对因业务需要必须知悉内幕信息的人员, 应制定严格的批准程序和监督防范措施;  
 成本效益原则。公司应当充分发挥各部门及每位员工的工作积极性, 尽量降低运营成本, 保证以合理的控制成本达到最佳的控制控制效果;  
 合法合规性原则。公司内部控制制度应当符合国家法律、法规、规章制度和各项规定, 并在此基础上遵循国际和行业的惯例制订;  
 全面性原则。内部控制制度必须涵盖公司经营管理的全过程, 并普遍适用于公司每一位员工, 不留有制度上的空白或漏洞;  
 审慎性原则。公司内部控制的核心是风险控制, 内部控制制度的制订要以审慎经营、防范和化解风险为出发点;  
 适时性原则。内部控制制度的制订应当具有前瞻性, 并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策调整等外部环境的改变及时进行相应的修改或完善。

(2) 内部风险控制的要求和内容  
 内部风险控制要求不相容职务分离、建立完善的岗位责任制和规范的岗位管理措施, 建立完整的信息科技保全系统, 建立授权控制制度, 建立有效的风险防范系统和快速反应机制。  
 内部风险控制的内容包括投资管理业务控制、市场管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制、档案管理等控制, 建立保密制度以及内部稽核控制等。

(3) 督察长制度  
 公司设督察长, 督察长由公司总经理提名, 董事会聘任, 并应当经全体独立董事同意。督察长的任免须经中国证监会核准。  
 督察长应当定期或不定期向全体董事报告工作, 并在董事会及董事会下设的专门委员会专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长发现基金及公司运作中存在违规时, 应当及时告知公司经理和相关业务负责人, 提出处理意见和整改建议, 并监督整改措施的制定和落实; 公司经理对存在违规问题不整改或者整改未达到要求的, 督察长应当向公司董事会、中国证监会及相关派出机构报告。

(4) 监察稽核部及风险管理部  
 监察稽核部和风险管理部依据公司的内部控制制度, 在所赋予的权限内, 按照所规定的程序和适当的方法, 进行公正客观的检查和评价。  
 监察稽核部和风险管理部负责调查评价公司内部控制制度的健全性、合理性、负责调查、评价公司有关部门执行公司各项规章制度控制的情况; 评价各项风险控制执行的有效性, 对内部控制制度的缺失提出补充建议; 进行日常风险监控工作; 协助评价基金财产风险状况; 负责包括基金经理在内审查在内的各项内部审计事务等。

3、基金管理人关于内部控制的披露真实、准确;  
 (2) 本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制。

## 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: 人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾玖元整  
 法定代表人: 田国立  
 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  
 中国银行卡服务电话: 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、外分行开展托管业务。  
 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)、社保基金、保险资金、QDII、RQDII、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2016年12月31日, 中国银行已托管534只证券投资基金, 其中境内基金500只, QDII基金34只, 覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金, 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重要组成部分, 秉承中国银行风险管理理念, 坚持“规范运作、稳健经营”的原则, 中国银行托管业务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流程、全范围的风险管控。

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”、“AAFA01/06”、“ISAE3402”和“ISAE16”等国际主流内控审阅结论的无保留意见的审阅报告。2016年, 中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“ISAE16”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, 能够有效保障托管资产的安全。

(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, 并及时通知基金管理人, 并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、相关服务机构

(一) 申购赎回发售机构  
 1、申购赎回代理券商(简称“一级交易商”)  
 (1) 长江证券股份有限公司  
 注册地址: 武汉市新华路特8号长江证券大厦  
 联系人: 秦博宇  
 联系电话: 021-68751860  
 传真: 027-85481900  
 客户电话: 95679或4008-888-999  
 公司网站: www.95679.com  
 (2) 大同证券有限责任公司  
 客户服务热线: 4007-121212  
 公司网站: www.dtsbc.com.cn  
 (3) 第一创业证券股份有限公司  
 注册地址: 深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼  
 法定代表人: 刘学民  
 客服电话: 95388  
 官网: www.firstcapital.com.cn  
 联系电话: 0755-23838751  
 联系人: 吴军  
 (4) 东吴证券股份有限公司  
 注册地址: 苏州工业园区星阳街5号东吴证券大厦  
 联系人: 路璐  
 联系电话: 0512-62938821  
 传真: 0512-65588021  
 客户电话: 95330  
 公司网站: http://www.dwzq.com.cn  
 (5) 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  
 联系人: 刘晨、李芳芳  
 联系电话: 021-22169999  
 传真: 021-62111877  
 客户电话: 95625  
 公司网站: www.ebscn.com  
 (6) 广发证券股份有限公司  
 注册地址: 广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316)房  
 办公地址: 广州市天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316)房  
 联系人: 黄岚  
 客户电话: 95675或致电各地营业网点  
 公司网站: www.gf.com.cn  
 (7) 中国国际金融股份有限公司  
 注册地址: 北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层  
 联系人: 罗春香、陈娜、康楠  
 联系电话: 010-65051166  
 传真: 010-65061168  
 客户电话: 400-910-1166  
 (8) 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  
 联系电话: 0561-9868689  
 客户电话: 95621  
 公司网站: www.gtja.com  
 (9) 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  
 联系人: 李娜  
 联系电话: 0755-82130833  
 传真: 0755-82133952  
 客户电话: 95536  
 公司网站: www.guosen.com.cn  
 (10) 海通证券股份有限公司  
 注册地址: 上海淮海中路98号  
 联系人: 李楠  
 联系电话: 021-23219061  
 客户电话: 95553, 或拨打各城市营业网点咨询电话  
 公司网站: www.htsec.com  
 (11) 红塔证券股份有限公司  
 注册地址: 中国云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦大楼  
 客户电话: 0871-3577930  
 公司网站: www.hongtaizq.com  
 (12) 华宝证券有限责任公司  
 注册地址: 上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼

联系电话: 021-20615583  
 传真: 021-68777822  
 客户电话: 400-820-9898, 021-38929908  
 公司网址: http://www.cnhsstock.com  
 (13) 华福证券有限责任公司  
 注册地址: 福州市五四路157号新天地大厦7、8层  
 联系电话: 0591-96326, 400-88-96326  
 客户电话: 96326 (福建省外请加拨0591)  
 公司网址: www.hfzq.com.cn  
 (14) 华泰证券股份有限公司  
 注册地址: 南京市江东中路228号  
 联系人: 庞晓涛  
 联系电话: 025-83389999  
 传真: 025-83387337  
 客户电话: 95597  
 公司网址: www.htsc.com.cn  
 (15) 平安证券股份有限公司  
 注册地址: 深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层  
 办公地址: 深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层  
 联系人: 周媛  
 电话: 0755-82435367  
 客户电话: 95511-8  
 公司网站: www.stock.pingan.com  
 (16) 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: 邓薇  
 联系电话: 0351-8686889  
 传真: 0351-8686619  
 客户电话: 400-666-1618, 95573  
 公司网站: www.i618.com.cn  
 (17) 上海证券有限责任公司  
 注册地址: 上海市四川中路213号久事商务大厦7楼  
 办公地址: 上海市四川中路213号久事商务大厦7楼  
 联系人: 邵珍珍  
 联系电话: 021-53686262  
 传真: 021-53686100, 021-53686200  
 客户电话: 021-962518  
 公司网站: www.sse.com.cn  
 (18) 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  
 联系人: 黄莹  
 联系电话: 021-33398989  
 传真: 021-33398224  
 客户电话: 95523或4008885523  
 公司网站: www.swhysc.com  
 (19) 申万宏源西部证券有限公司  
 注册地址: 新疆乌鲁木齐高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室  
 办公地址: 新疆乌鲁木齐高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室  
 联系人: 黄莹  
 联系电话: 0991-2307105  
 传真: 0991-2301927  
 客户电话: 400-800-0562  
 公司网站: www.hysec.com  
 (20) 西南证券股份有限公司  
 注册地址: 重庆市江北区桥北苑8号  
 办公地址: 重庆江北区江北桥北苑8号西南证券大厦  
 联系人: 张煜  
 电话: 023-6376212  
 客户电话: 4008-096-096  
 公司网站: www.swsc.com.cn  
 (21) 兴业证券股份有限公司  
 注册地址: 福州市湖东路268号  
 联系人: 业务公共邮箱  
 联系电话: 0591-38281963  
 客户电话: 95562  
 公司网站: www.xyzq.com.cn  
 (22) 中国银河证券股份有限公司  
 注册地址: 北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座  
 联系人: 邓琳  
 联系电话: 010-66568292  
 客户电话: 95551  
 公司网站: www.chinastock.com.cn  
 (23) 招商证券股份有限公司  
 注册地址: 深圳市福田区益田路江苏大厦A座39—45层  
 办公地址: 深圳市福田区益田路江苏大厦A座39—45层  
 联系人: 黄莉娟  
 联系电话: 0755-8296017  
 客户电话: 4008885665, 95565  
 公司网站: www.newone.com.cn  
 (24) 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  
 联系人: 戴菁  
 联系电话: 0791-83811898  
 客户电话: 95535  
 公司网站: www.avicsec.com  
 (25) 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  
 联系人: 吴昊  
 联系电话: 0531-68889155  
 传真: 0531-68889752  
 客户电话: 95539  
 公司网站: www.zts.com.cn  
 (26) 中国中投证券有限责任公司  
 注册地址: 深圳福田区益田路6003号荣超商务中心A座第04层、18-21层  
 联系人: 张鹏  
 联系电话: 0755-82023442  
 传真: 0755-82026539  
 客户电话: 95532  
 公司网站: www.china-invscn  
 (27) 中信建投证券股份有限公司  
 注册地址: 北京市朝阳区安立路66号号楼  
 办公地址: 北京市朝阳区门内大街188号  
 联系人: 许月明  
 联系电话: 400-889-5548  
 客户电话: 400-8888-108(免长途费), 95587  
 公司网站: www.csc108.com  
 (28) 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  
 联系人: 王东明  
 联系电话: 010-60838888  
 传真: 010-6083 6029  
 客户电话: 95548  
 公司网站: www.cscitic.com  
 2、二级市场交易代理券商  
 包括具有经纪业务资格和上海证券交易所会员资格的所有证券公司, 基金管理人可根据有关法律法规的要求, 选择其它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  
 名称: 中国证券投资基金登记结算有限责任公司  
 地址: 中国北京西城区金融大街27号投资广场22层  
 法定代表人: 陈显见  
 联系人: 刘永卫  
 电话: 021-58872625  
 (三) 律师事务所及经办律师  
 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: 韩朝  
 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) 会计师事务所及经办注册会计师  
 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) 23238900  
 联系人: 曹阳  
 经办注册会计师: 薛竞、曹阳

## 四、基金名称

本基金名称: 上证180成长交易型开放式指数证券投资基金  
 五、基金的类型  
 本基金类型: 股票型指数基金  
 本基金运作方式: 交易型、开放式

六、基金的投资目标  
 紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。  
 七、基金的投资范围  
 本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象, 指数化投资比例因投资于指数成份股、备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的95%, 如因标的指数成份股调整, 基金投资组合中现金替代、现金差额、基金规模或市场变化等因素导致基金投资组合不符合上述标准的, 基金管理人将在10个交易日内进行调整。同时为了更好地实现投资目标, 本基金还可少量投资于新股(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、权证及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, 该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略  
 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具, 基金管理人

人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。

(一) 投资策略  
 1、股票资产指数化投资策略  
 本基金股票资产投资原则上采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数。通常情况下, 本基金根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量, 并根据标的指数成份及其权重的变动进行相应调整。在因特殊情况(如成份股停牌、流动性不足、法律法规限制等)导致无法获得足够数量的股票时, 本基金可以根据市场情况, 结合经验判断, 综合考虑相关性、估值、流动性等因素选择标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代(同行行业股票优先考虑), 以期在规定的风险承受限度之内, 尽量缩小跟踪误差。  
 2、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, 债券投资的主要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。  
 3、权证投资策略  
 本基金具备投资权证的条件。本基金在权证投资中将将对权证标的证券的基本面进行研究, 结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值, 主要考虑采用的策略包括: 杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

(二) 投资组合管理  
 本基金采用完全复制法进行指数化投资, 按照成份股在上证180成长指数中的基准权重构建指数化投资组合。当期预期成份股发生变动时, 按照成份股发生变动进行相应调整, 主要考虑采用的策略包括: 杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认股权证策略、买入保护性的认股权证策略等。  
 (三) 跟踪误差控制  
 本基金采用完全复制法进行指数化投资, 按照成份股在上证180成长指数中的基准权重构建指数化投资组合。当期预期成份股发生变动时, 按照成份股发生变动进行相应调整, 主要考虑采用的策略包括: 杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认股权证策略、买入保护性的认股权证策略等。

跟踪标的指数成份股公司信息(如: 股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌等), 以及成份股公司其他重大信息, 分析这些信息对指数的影响, 并根据这些信息确定基金投资组合每日交易策略。  
 3、标的指数成份股临时调整  
 在标的指数成份股调整周期内, 若出现成份股票临时调整的情形, 本基金管理人将密切关注并跟踪成份股的调整, 并及时制定相应的投资组合调整策略。  
 4、申购赎回情况的跟踪与分析  
 跟踪本基金申购和赎回信息, 结合基金的现金头寸管理, 分析其对组合的影响, 制定交易策略以应对基金的中购赎回。

5、跟踪误差的控制  
 每日跟踪基金组合与标的指数的表现, 跟踪误差, 每月、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数的表现, 跟踪误差变化情况及其原因, 并优化跟踪误差管理方案。  
 在正常情况下, 本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%, 年跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围, 基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

九、基金的业绩比较基准  
 本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数的上涨180成长指数(指数代码为000028)。  
 上证180风格指数是由中证指数公司编制并发布, 它以上证180指数为样本空间, 共包含4只指数, 包括上证180成长指数、上证180价值指数、上证180相对成长指数和上证180相对价值指数。其中, 上证180成长指数是从上证180指数样本中, 挑选最具代表性的60只成长股形成成份股, 该指数从长期特征的角度进一步刻画了上证180指数, 也为投资者提供了新的业绩基准和资产配置工具。

随着市场环境的变化, 如果上述标的指数不适用本基金时, 本基金管理人可以根据维护基金份额持有人合法权益的原则, 进行适当的程序变更更本基金的标的指数, 并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。其中, 若标的指数变更更涉及本系列基金投资组合投资策略的实质性变更, 则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会, 并报中国证监会备案或批准。若标的指数的变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等), 则无需召开基金份额持有人大会, 基金管理人应在取得基金托管人同意后, 报中国证监会备案, 并应于变更前30个工作日内在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

十、基金的投资收益特征  
 本基金为股票型指数基金, 具有较高风险、较高预期收益的特征, 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。  
 十一、基金的投资组合报告  
 本基金的投资组合报告所载的数据截至2016年12月31日, 本投资组合中所列数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	52,193,495.94	97.76
2	其中: 股票	52,193,495.94	97.76
3	固定收益投资	-	-
4	其中: 债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	其他资产	52,193,495.94	97.76
9	合计	52,193,495.94	97.76

2、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	-	-
C	制造业	11,804,688.75	22.30
D	电力、热力、燃气及生产供应业	338,430.00	0.64
E	建筑业	2,347,014.00	4.43
F	批发和零售业	459,311.60	0.87
G	交通运输、仓储和邮政业	134,756.00	0.26
H	住宿和餐饮业	62,448.00	0.11
I	信息技术、软件和信息技术服务业	1,980,572.50	3.65
J	金融业	30,564,218.29	57.73
K	房地产业	4,136,616.80	7.72
L	租赁和商务服务业	415,200.00	0.78
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	卫生和社工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	其他	-	-
	合计	52,193,495.94	98.58

(2) 报告期末非指数投资按行业分类的境内股票投资组合  
 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)
----	------	------	-------	---------