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

2013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2013年10月23日,有关财务数据和净值表现截止日为2013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: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

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:韩东霞

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。现任华宝兴业基金管理有限公司董事长、华宝信托有限责任公司董事长、华宝投资有限公司董事、总经理,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。

Inès de Dinechin女士,董事,硕士。曾任法国兴业银行外汇及汇率公司销售和风险管理方案负责人、分级产品全球负责人、人力资源全球负责人,领先资产管理有限公司首席执行官。现任领先资产管理有限公司董事长。

谢文杰先生,董事,金融学硕士。曾任汇丰银行外汇及期权交易员、法国兴业银行及投资银行初级市场及衍生品团队负责人、法国兴业银行及投资银行债务融资部亚洲区(除日本外)董事总经理兼结构化衍生品主任、法国兴业亚洲有限公司环球市场部中国区销售及交易部门主管、法国兴业亚洲有限公司领先资产管理中国区业务部门主管、华宝兴业基金管理有限公司副总经理。现任领先资产管理有限公司董事总经理,亚洲地区主管。

张群先生,独立董事,博士、教授、博导。曾任北京科技大学经济管理学院(现东凌经济管理学院)教授、院长。现任北京科技大学东凌经济管理学院教授、学术委员会副主席,管理科学研究所所长。

罗飞先生,独立董事,博士、教授、博导。曾任中南财经政法大学会计系讲师、会计系西方会计研究室主任、会计系副主任、会计学院院长。现任中南财经政法大学经济与会计监管中心主任。

江岩女士,独立董事,法学学士、工商管理硕士。曾任中国政法大学教师、深圳市轻工集团公司法律秘书、南方证券股份有限公司深圳总部总经理、国际业务总部总经理助理、总经理。现任北京竞天公诚律师事务所律师。

2、监事会成员

张永光(Jackson CHEUNG)先生,监事,工商管理硕士。曾在法国兴业银行主管银团贷款、项目融资、固定收益、外汇交易、衍生产品及结构性融资等工作,法国兴业银行亚洲区债务融资及衍生产品业务部总管。现任法国兴业银行集团中国区总裁。

贾璐女士,监事,硕士研究生,高级工程师。曾任宝钢自动化部组干科主办,宝钢国贸公司人事部人才开发室主任,宝钢国际公司人力资源部部长、组织部部长,宝钢资源(国际)公司总经理助理。现任华宝投资公司副总经理,宝钢集团金融系统党委副书记。

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。现任公司营运副总监。

3、高级管理人员

HUANG Xiaoyi Helen(黄小薏)女士,总经理,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。

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股票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。

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

徐林明先生,复旦大学经济学硕士,FRM,证券从业经历11年,曾在兴业证券、凯龙财经(上海)有限公司、中原证券从事金融工程研究工作。2005年8月加入华宝兴业基金管理有限公司,任金融工程部数量分析师。2009年9月起任华宝兴业中证100指数基金基金经理。2010年2月起任量化投资部总经理。2010年4月起担任华宝兴业上证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。

5、投资决策委员会成员

任志强先生,副总经理、投资总监。

郭鹏飞先生,国内投资部总经理、华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理、华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金经理。

刘自强先生,投资副总监、华宝兴业动力组合股票型证券投资基金基金经理。

王智慧先生,研究部总经理、华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理、华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金基金经理、华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金经理。

邵喆阳先生,国内投资部副总经理、华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业服务优选股票型证券投资基金基金经理。

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:姜建清

注册资本:人民币349,018,545,827元

联系电话:010-66105799

联系人:赵会军

(二)主要人员情况

截至2013年9月末,中国工商银行资产托管部共有员工179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、安心账户资金、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2013年9月,中国工商银行共托管证券投资基金337只,其中封闭式5只,开放式332只。自2003年以来,本行连续十年获得香港《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41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)基金托管人的职责

基金托管人应当履行下列职责:

1.安全保管基金财产;

2.按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户;

3.对所托管的不同基金财产分别设置账户,确保基金财产的完整与独立;

4.保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

5.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;

6.办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

7.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;

8.复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格;

9.按照规定召集基金份额持有人大会;

10.按照规定监督基金管理人的投资运作;

11.法律法规和《基金合同》规定的其它职责。

(五)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。继2005、2007、2009、2010、2011年五次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的SAS70(审计标准第70号)审阅后,2012年中国工商银行资产托管部第六次通过ISAE3402(原SAS70)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。

(六)、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》、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: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

直销柜台电话:021-38505731、38505732、021-38505888-301或302

直销柜台传真:021-50499663、50499667、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

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

(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

(4)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

(5)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

(6)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:傅育宁

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

(7)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:董文标

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

(8)中信银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

24小时客户服务热线:95558

网址:bank.ecitic.com

(9)平安银行股份有限公司

地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

法定代表人: 孙建一

联系人:张青

联系电话:0755-82088888

传真电话:0755-82080714

客户服务电话:95501

公司网址: www.sdb.com.cn

(10)上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号

法定代表人:吉晓辉

联系人:倪苏云

电话:021-61618888

传真:021-63604199

客户服务热线:95528

公司网址:www.spdb.com.cn

(11)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

(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:天津市河西区马场道 201-205 号

法定代表人:刘宝凤

网址:www.cbhb.com.cn

客户服务电话:400 888 8811

(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)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:刘安东

联系人:陈春林

客服电话:95580

网址:www.psbc.com

(16)国泰君安证券股份有限公司

注册地址:上海浦东新区商城路618号

法定代表人:万建华

电话:021-38676666

传真:021-38670666

联系人:芮敏祺

服务热线:400-8888-666

公司网站:www.gtja.com

(17)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:徐浩明

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

(18)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

(19)申银万国证券股份有限公司

注册地址:上海市常熟路171号

办公地址:上海市常熟路171号

法定代表人:储晓明

电话:021-33389888或21-54033888

传真:021-54038844

客服电话:95523或4008895523

电话委托:021-962505

网址:www.swyg.com

(20)中信证券股份有限公司

注册地址:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层

法定代表人:王东明

电话:010-60838888

传真:010-60833739

联系人:陈忠

公司网址:www.ce.ecitic.com

(21)中信证券(浙江)有限责任公司(原中信金通证券)

住所:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

法定代表人:沈强

客户服务电话:0571- 95548

公司网址:www.bigsun.com.cn

(22)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:齐晓燕

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

(23)中信万通证券有限责任公司

注册地址:青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)

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

客户咨询电话:0532-96577

公司网址:www.zxwt.com.cn

(24) 华泰证券股份有限公司

住所:南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人:吴万善

电话:025-84457777-882

传真:025-84579763

联系人:万鸣

公司网址: www.htsc.com.cn

客户服务热线:95597

(25)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:徐勇力

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

(26)东海证券股份有限公司

注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18楼

公司地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18楼

法定代表人:刘化军

全国统一客服热线:400-888-8588

东海证券网站:http://www.longone.com.cn

(27)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:杜航

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

(28)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

(29)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

(30)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:021-58870011

传真:021-68596919

客服热线:400-700-9665

好买基金交易网:www.ehowbuy.com

(31) 深圳众禄基金销售有限公司

办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

法定代表人:薛峰

电话:0755-33227950

传真:0755-82080798

客服热线:4006-788-887

公司网址:www.jjmmw.com

(32) 杭州数米基金销售有限公司

办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人:陈柏青

电话:0571-28829790,021-60897869

传真:0571-26698533

客服热线:4000-766-123

公司网址:http://www.fund123.cn/

(33) 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10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

(34)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

(35)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所: 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

办公地址:北京市西城区金融大街35号国企大厦C座9层

法定代表人:马令海

客户服务电话: 4008507771

网址:t.jrj.com

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:安永华明会计师事务所

法定代表人:葛明

住所:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层

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50楼

公司电话:021-22288888(注:公司总机)

公司传真:021-22280000(注:传真总机)

签章会计师:徐艳、蒋燕华

业务联系人:蒋燕华

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2013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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	211,916,794.61	93.84
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
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	12,983,022.15	5.75
7	其他资产	920,968.50	0.41
8	合计	225,820,785.26	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、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