上证180价值交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要

2018年第2号

基金管理人：华宝基金管理有限公司
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。

基金管理人保证《上证180价值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。本基金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。

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。

投资有风险,投资人申购本基金时应认真阅读本基金招募说明书。

本摘要根据《基金合同》和《招募说明书》编写,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》。

本招募说明书摘要所载内容截止日为2018年10月23日,有关财务数据和净值表现截止日为2018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:孔祥清

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Warburg Pincus Asset Management, L.P.持有49%的股份。

（二）基金管理人主要人员情况

1、董事会成员

孔祥清先生,董事长,硕士,高级会计师。曾任宝钢计财部资金处主办、主管、副处长,宝钢集团财务有限公司总经理。现任华宝基金管理有限公司董事长,中国宝武钢铁集团有限公司产业金融党工委副书记、纪委书记,法兴华宝汽车租赁(上海)有限公司董事长,华宝信托有限责任公司董事,华宝都鼎(上海)融资租赁有限公司董事长,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月加入华宝基金管理有限公司,先后担任公司营运总监、董事会秘书、副总经理,现任华宝基金管理有限公司总经理。

Michael Martin先生,董事,博士。曾任Wachtell Lipton Rosen & Katz律师助理;第一波士顿银行董事总经理;瑞银证券董事总经理;Brooklyn NY Holdings总裁;现任美国华平投资集团全球执行委员会成员、全球金融行业负责人、董事总经理,美国Financial Engines董事、加拿大DBRS董事、美国Mariner Finance董事。

周朗朗先生,董事,本科。曾任瑞士信贷第一波士顿(加拿大)分析师;花旗银行(香港)投资银行部分析师;现任美国华平集团中国金融行业负责人、董事总经理,华融资产管理股份有限公司董事,上海灿谷投资管理咨询服务有限公司董事。

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,华彬国际投资(集团)有限公司高级顾问。

2、监事会成员

朱莉丽女士,监事,硕士。曾就职于美林投资银行部、德意志银行投资银行部;现任美国华平集团执行董事。

杨莹女士,监事,本科。曾在三九集团、中国平安保险(集团)股份有限公司、永亨银行(中国)有限公司、中国民生银行、华宝投资有限公司工作,现任华宝信托有限责任公司风险管理部副总经理。

贺桂先先生,监事,本科。曾任华宝信托有限责任公司研究部副总经理;现任华宝基金管理有限公司营运副总监兼北京分公司总经理兼综合管理部总经理。

王波先生,监事,硕士。曾任上海证券报记者;现任华宝基金管理有限公司互金业务总监兼互金策划部总经理。

3、高级管理人员

孔祥清先生,董事长,简历同上。

HUANG Xiaoyi Helen(黄小薏)女士,总经理,简历同上。

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,现任华宝基金管理有限公司副总经理。

欧江洪先生,副总经理,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,华宝投资有限公司总经理助理兼行政人事部总经理、董事会秘书,宝钢金融系统党委组织部部长、党委办公室主任。现任华宝基金管理有限公司副总经理。

李慧勇先生,副总经理,硕士。曾在上海申银万国证券研究所有限公司担任董事总经理/所长助理/研究执行委员会副主任/首席分析师的职务。现任华宝基金管理有限公司副总经理。

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月起任上证180价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证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月起任华宝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,2018年4月起任华宝中证500指数增强型发起式证券投资基金基金经理,2018年6月起任华宝中证全指证券公司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,2018年8月起任华宝中证1000指数分级证券投资基金基金经理。

5、权益投资决策委员会成员

刘自强先生,投资总监、华宝动力组合混合型证券投资基金基金经理、华宝国策导向混合型证券投资基金基金经理、华宝未来主导产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

闫旭女士,投资总监、国内投资部总经理、华宝行业精选混合型证券投资基金基金经理、华宝收益增长混合型证券投资基金基金经理、华宝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、华宝宝康消费品证券投资基金基金经理、华宝品质生活股票型证券投资基金基金经理、华宝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,华宝先进成长混合型证券投资基金基金经理。

蔡目荣先生,国内投资部副总经理、华宝多策略增长开放式证券投资基金基金经理、华宝资源优选混合型证券投资基金基金经理、华宝价值发现混合型证券投资基金、华宝绿色主题混合型证券投资基金基金经理。

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:郭明

（二）主要人员情况

截至2018年6月,中国工商银行资产托管部共有员工212人,平均年龄33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、基本养老保险、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2017年6月,中国工商银行共托管证券投资基金745只。自2003年以来,本行连续十四年获得香港《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54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。

2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014、2015、2016、2017共十一次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的ISAE3402审阅,获得无保留意见的控制及有效性报告。

（四）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。2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014、2015、2016、2017共十一次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的ISAE3402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。

（五）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、基金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、申购赎回代理券商(简称“一级交易商”)

(1)腾安基金销售(深圳)有限公司

联系电话:95017

(2)国盛证券有限责任公司

联系电话:400-822-2111

(3)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

邮编:518026

法定代表人:王连志

联系人:陈剑虹

联系电话:4008-001-001

客户电话:95517

公司网址:www.essence.com.cn

(4)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

联系人:王星

传真:022-28451958

客户电话:400-651-5988

公司网址:www.ewww.com.cn

(5)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

邮编:518034

法定代表人:丁益

联系人:金夏

客户电话:400-6666-888

公司网址:www.cgws.com

(6)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

邮编:430015

法定代表人:尤习贵

联系人:奚博宇

联系电话:027-65799999

传真:027-85481900

客户电话:95579

公司网址:www.95579.com

(7)大同证券有限责任公司

办公地址:山西省太原市小店区长治路111号山西世贸中心A座F12

法定代表人:董祥

联系人:薛津

传真:0351-7219891

客户电话:4007121212

公司网址:www.dtsbc.com.cn

(8)德邦证券股份有限公司

办公地址:上海市福山路500号城建国际中心26楼

法定代表人:武晓春

联系人:刘熠

联系电话:95353

传真:862168767981

客户电话:400-8888-128

公司网址:www.tebon.com.cn

(9)第一创业证券股份有限公司

办公地址:深圳市福田中心区福华一路115号投行大厦18F

邮编:518000

法定代表人:刘学民

联系人:李晓伟

传真:0755-25838701

客户电话:95358

公司网址:www.firstcapital.com.cn/

(10)东方证券股份有限公司

办公地址:上海市中山南路318号东方国际金融广场2号楼21-29层

邮编:200010

法定代表人:潘鑫军

联系人:王欣

联系电话:95503

传真:021-63326729

客户电话:95503

公司网址:www.dfzq.com.cn

(11)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

邮编:215021

法定代表人:范力

联系人:陆晓

传真:0512-62938527

客户电话:95330

公司网址:www.dwzq.com.cn

(12)东兴证券股份有限公司

办公地址: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

联系人:夏锐

传真:010-66555246

客户电话:400-8888-993、95309

公司网址:www.dxzq.net.cn

(13)方正证券股份有限公司

办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座40F-43F

法定代表人:高利

联系人:程博怡

客户电话:95571

公司网址:www.foundersc.com

(14)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

联系人:李晓晢

传真:021-22169134

客户电话:95525

公司网址:www.ebscn.com

(15)广发证券股份有限公司

办公地址:广东省广州市天河北路183号大都会广场43楼

法定代表人:孙树明

联系人:马梦洁

客户电话:95575

公司网址:www.gf.com.cn

(16)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

邮编:214121

法定代表人:姚志勇

联系人:祁昊

传真:0510-82830162

客户电话:95570

公司网址:http://www.glsc.com.cn

(17)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

联系人:钟伟镇

联系电话:400-888-6628

传真:021-38670666

客户电话:95521

公司网址:www.gtja.com

(18)国信证券股份有限公司

办公地址:深圳市红岭中路1012号国信证券大厦

法定代表人:何如

联系人:周杨

联系电话:95536

传真:0755-82133952

客户电话:95536

公司网址:www.guosen.com.cn

(19)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

联系人:李楠

客户电话: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

(20)红塔证券股份有限公司

法定代表人:况雨林

客户电话:0871-3577930

公司网址:www.hongtazq.com

(21)宏信证券有限责任公司

办公地址:中国四川成都市人民南路二段十八号川信大厦10楼

法定代表人:吴玉明

联系人:张鋆

传真:028-86199079

客户电话:4008366366

公司网址:www.hx818.com

(22)华安证券股份有限公司

办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

邮编:230081

法定代表人:章宏韬

联系人:范超

传真:0551-65161672

客户电话:95318

公司网址:www.hazq.com

(23)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

邮编:200120

法定代表人:陈林

联系电话:400-820-9898

传真:021-68777822

客户电话:400-820-9898

公司网址:www.cnhbstock.com

(24)华福证券有限责任公司

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1088号招商银行上海大厦18-19层

法定代表人:黄金琳

联系人:王虹

传真:021-20655196

客户电话:95547

公司网址:www.hfzq.com.cn

(25)华泰证券股份有限公司

办公地址:南京市江东中路288号华泰证券一号楼

邮编:210019

法定代表人:周易

联系人:马艺卿

传真:021-83387254

客户电话:95597

公司网址:www.htsc.com.cn

(26)中国民族证券有限责任公司

办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座40F-43F

法定代表人:姜志军

联系人:程博怡

客户电话:400-889-5618

公司网址:www.e5618.com

(27)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

联系人:周驰

联系电话:95511

传真:0755-82435367

客户电话:95511-8

公司网址:www.stock.pingan.com

(28)山西证券股份有限公司

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

法定代表人:侯巍

联系人:韩笑

传真:0351-8686619

客户电话:400-666-1618、95573

公司网址:www.i618.com.cn

(29)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

联系人:邵珍珍

传真:021-53686100、021-53686200

客户电话:021-962518

公司网址:www.962518.com

(30)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

邮编:200031

法定代表人:李梅

联系人:陈飙

联系电话:95523

传真:021-33388224

客户电话:95523

公司网址:www.swhysc.com

(31)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

联系人:张晓辰

传真:010-63081344

客户电话:95321

公司网址:www.cindasc.com

(32)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

联系人:(公邮)

客户电话:95562

公司网址:www.xyzq.com.cn

(33)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

邮编:100033

法定代表人:陈共炎

联系人:辛国政

联系电话:95551

传真:010-83574807

客户电话:4008-888-888或95551

公司网址:www.chinastock.com.cn

(34)招商证券股份有限公司

办公地址:深圳福田区益田路江苏大厦A座30楼

法定代表人:霍达

联系人:黄婵君

联系电话:95565

传真:0755-82943227

客户电话:95565

公司网址:www.newone.com.cn

(35)中航证券有限公司

办公地址:北京市朝阳区望京东园四区2号 中航资本大厦35层

邮编:100102

法定代表人:王晓峰

联系人:王紫雯

传真:010-59562637

客户电话:400-8866-567

公司网址:www.avicsec.com

(36)中国国际金融股份有限公司

办公地址: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:毕明建

联系人:吕卓

联系电话:010-65051166

传真:010-65058065

客户电话:400-910-1166

公司网址:www.cicc.com

(37)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

联系人:秦雨晴

传真:021-20315125

客户电话:95538

公司网址:www.zts.com.cn

(38)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

联系人:许梦园

联系电话:400-888-8108

客户电话:95587

公司网址:www.csc108.com

(39)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

邮编:100026

法定代表人:张佑君

联系人:王一通

联系电话:400-889-5548

传真:010-60833739

客户电话:95548

公司网址:www.cs.ecitic.com

(40)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

邮编:100026

法定代表人:张佑君

联系人:王一通

联系电话:400-889-5548

传真:010-60833739

客户电话:95548

公司网址:www.cs.ecitic.com

(41)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

邮编:200120

法定代表人:宁敏

联系人:许慧琳

联系电话:400-620-8888

传真:021-50372474

客户电话:4006208888

公司网址:www.bocichina.com

2、二级市场交易代理券商

包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。

3、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:陈耀先

联系人:刘永卫

联系电话:021-58872625

(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:上证180价值交易型开放式指数证券投资基金

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括上证180价值指数的成份股及其备选成份股、新股(首次公开发行或增发)、债券,以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资于上证180价值指数的成份股和备选成份股的资产比例不低于该基金资产净值的95%,同时为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于新股、债券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%。

(三)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股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、法规法律限制等)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、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代(同行业股票优先考虑),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、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,或用作杠杆工具放大基金的投资。

(四)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价值指数中的基准权重构建指数化投资组合。当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,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人会在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。

1、标的指数定期调整

根据标的指数的编制规则及调整公告,本基金在指数成份股调整生效前,分析并确定组合调整策略,及时进行投资组合的优化调整,减少流动性冲击,尽量减少标的指数成份股变动所带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

2、成份股公司信息的日常跟踪与分析

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、标的指数成份股票临时调整

在标的指数成份股票调整周期内,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样本股票的调整,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申购赎回。

5、跟踪偏离度的监控与管理

每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度,每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因,并优化跟踪偏离度管理方案。

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。

(五)标的指数

本基金的标的指数为上证风格指数系列中的上证180价值指数(指数代码为000029.SH)。

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价值指数是从上证180指数样本股中,挑选最具代表性的60只价值股票形成指数。该指数从风格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,本基金管理人可以依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,若标的指数变更涉及本系列基金投资范围或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,并报中国证监会核准或者备案。若标的指数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。并应至少提前30个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

(六)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、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%;

d、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%;

e、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%;

f、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;

g、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;

h、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该比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

i、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;

j、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。除上述第h,i项外,由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动、标的指数成分股调整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的,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。

(七)业绩比较基准

本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数变更的,业绩比较基准随之变更并公告。

(八)风险收益特征

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。

七、基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至2018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	148,835,047.91	98.80
	其中:股票	148,835,047.91	98.80
2	基金投资	-	-
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	1,405,164.41	0.93
8	其他资产	400,341.22	0.27
9	合计	150,640,553.54	100.00

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	6,302,870.00	4.19
C	制造业	17,613,218.27	11.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,571,175.77	5.04
E	建筑业	12,188,505.42	8.11
F	批发和零售业	943,352.50	0.63
G	交通运输、仓储和邮政业	4,451,796.61	2.96
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	93,198,842.82	61.98
K	房地产业	6,565,286.52	4.37
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	148,835,047.91	98.98

(2)报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

(3)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

(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

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	244,006	16,714,411.00	11.12
2	600036	招商银行	412,758	12,667,543.02	8.42
3	601166	兴业银行	493,152	7,865,774.40	5.23
4	600016	民生银行	1,124,012	7,126,236.08	4.74
5	601328	交通银行	1,092,900	6,382,536.00	4.24
6	601288	农业银行	1,509,024	5,870,103.36	3.90
7	601398	工商银行	883,400	5,097,218.00	3.39
8	600000	浦发银行	467,027	4,959,826.74	3.30
9	601668	中国建筑	840,878	4,616,420.22	3.07
10	600104	上汽集团	137,535	4,577,164.80	3.04

(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

本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

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。

10、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。

11、投资组合报告附注

(1)上证180价值ETF基金截至2018年9月30日持仓前十名证券中的招商银行(600036)于2018年5月4日收到银保监会处罚通知。由于公司存在:(一)内控管理严重违反审慎经营规则;(二)违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款;(三)同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保;(四)销售同业非保本理财产品时违规承诺保本;(五)违规将票据贴现资金直接转回出票人账户;(六)为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保;(七)未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目;(八)高管人员在获得任职资格核准前履职;(九)未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务;(十)未严格审查贸易背景真实性开立信用证;(十一)违规签订保本合同销售同业非保本理财产品;(十二)非真实转让信贷资产;(十三)违规向典当行发放贷款;(十四)违规向关系人发放信用贷款;被处以罚款。

上证180价值ETF基金截至2018年9月30日持仓前十名证券中的兴业银行(601166)于2018年5月4日收到银保监会处罚通知。由于公司存在:(一)重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告;(二)非真实转让信贷资产;(三)无授信额度或超授信额度办理同业业务;(四)内控管理严重违反审慎经营规则,多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规;(五)同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保;(六)债券卖出回购业务违规出表;(七)个人理财资金违规投资;(八)提供日期倒签的材料;(九)部分非现场监管统计数据与事实不符;(十)个别董事未经任职资格核准即履职;(十一)变相批量转让个人贷款;(十二)向四证不全的房地产项目提供融资;被处以罚款。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析,认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响,因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内,本基金投资的前十名证券的其余八名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

(2)基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,525.34
2	应收证券清算款	397,532.28
3	应收股利	-
4	应收利息	283.60
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	400,341.22

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5)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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

(6)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

本基金本报告期末积极投资股票不存在流通受限。

八、基金的业绩

本基金业绩数据为截止2018年9月30日的数据,本报告中所列数据未经审计。

(一)本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

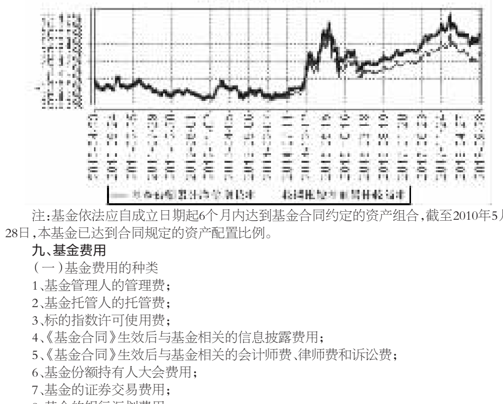
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2010/04/23-2010/12/31	-12.56%	1.67%	-11.08%	1.67%	-1.48%	0.00%
2011/01/01-2011/12/31	-14.84%	1.28%	-15.76%	1.27%	0.92%	0.01%
2012/01/01-2012/12/31	16.46%	1.15%	13.60%	1.14%	2.86%	0.01%
2013/01/01-2013/12/31	-9.67%	1.56%	-12.73%	1.54%	3.06%	0.02%
2014/01/01-2014/12/31	73.65%	1.41%	67.47%	1.41%	6.18%	0.00%
2015/01/01-2015/12/31	2.09%	2.43%	0.47%	2.48%	1.62%	-0.05%
2016/01/01-2016/12/31	-1.95%	1.13%	-4.04%	1.15%	2.09%	-0.02%
2017/01/01-2017/12/31	28.16%	0.68%	23.39%	0.69%	4.77%	-0.01%
2018/01/01-2018/09/30	-3.37%	1.20%	-7.31%	1.22%	3.94%	-0.02%
2010/04/23-2018/09/30	68.61%	1.46%	37.12%	1.47%	31.49%	-0.01%

(二)自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华宝上证180价值交易型开放式指数证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010年4月23日至2018年9月30日)



注:基金依法应自成立日期起6个月内达到基金合同约定的资产组合,截至2010年5月28日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

九、基金费用

(一)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、标的指数许可使用费;

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、律师费和诉讼费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、基金收益分配中发生的费用;

10、基金上市费及年费;

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。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

(二)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0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H=E\times0.5\%\div$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

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

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:

$H=E\times0.1\%\div$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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述(一)基金费用的种类中第3-11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。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

(五)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十、《招募说明书》更新部分的说明

根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)及其他有关规定,华宝基金管理有限公司对《上证180价值交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》作如下更新:

1、“三、基金管理人”更新了基金管理人的相关信息。

2、“四、基金托管人”更新了基金托管人的相关信息。

3、“五、相关服务机构”更新了“一、基金份额发售机构”中申购赎回代理券商的相关信息。

4、“十、基金份额的申购与赎回”更新了申购、赎回清单的格式的相关内容。

5、“十一、基金的投资”更新了截至2018年9月30日的基金的投资组合报告。

6、“十二、基金的业绩”更新了截至2018年9月30日的基金业绩数据。

7、“二十四、其他应披露事项”对本报告期内的相关公告作了信息披露。

上述内容仅为摘要,须与本基金《招募说明书》后面所载之详细资料一并阅读。

华宝基金管理有限公司

2018年12月5日