

华宝兴业港股通恒生中国（香港上市）25指数证券投资 基金（LOF）上市交易公告书

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

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：2017年5月8日

公告日期：2017年5月3日

目 录

一、 重要声明与提示.....	1
二、 基金概览.....	2
三、 基金的募集与上市交易.....	3
四、 持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	6
五、 基金主要当事人介绍.....	8
六、 基金合同的内容摘要.....	15
七、 基金财务状况.....	16
八、 基金投资组合.....	18
九、 重大事件揭示.....	22
十、 基金管理人承诺.....	23
十一、 基金托管人承诺.....	24
十二、 备查文件目录.....	25

一、 重要声明与提示

《华宝兴业港股通恒生中国（香港上市）25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，华宝兴业港股通恒生中国（香港上市）25指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）管理人华宝兴业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。本基金托管人中国建设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兴业港股通恒生中国（香港上市）25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，请投资者详细查阅刊登在2017年3月10日《上海证券报》及华宝兴业基金管理有限公司网站（www.fsfund.com）上的《华宝兴业港股通恒生中国（香港上市）25指数证券投资基金（LOF）招募说明书》以及同日发布在本公司网站

（www.fsfund.com）上的《华宝兴业港股通恒生中国（香港上市）25指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）。

二、 基金概览

- (一) 基金名称：华宝兴业港股通恒生中国（香港上市）25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2017年4月28日，本基金的基金份额总额：311,438,053.19份
- (五) 基金份额净值：截至2017年4月28日，本基金份额净值：0.9991元
- (六) 本次上市交易的基金份额总额：199,202,619.00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：2017年5月8日
- (九) 基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司
- (十) 基金托管人：招商证券股份有限公司
- (十一) 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【2017】258号
- 2、基金合同生效日：2017年4月20日
- 3、发售日期：2017年3月20日起至2017年4月14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单位。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

第一创业证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、平安证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、华宝证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中泰证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、江海证券有限公司、国都证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、东兴证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、申万宏源西部证券有限公司、招商证券股份有限公司、中信期货有限公司、国金证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、深圳腾元基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、浙

江同花顺基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、上海陆金所资产管理有限公司、珠海盈米财富管理有限公司、北京肯特瑞财富投资管理有限公司、北京蛋卷基金销售有限公司、中银国际证券有限责任公司、光大证券股份有限公司。

7、验资机构名称：德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)

8、募集资金总额及入账情况

本次募集的有效净认购金额为311,381,552.07元人民币,折合基金份额311,381,552.07份;利息结转份额56,501.12份,总确认份额为311,438,053.19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2017年4月18日全额划入本基金在基金托管人在交通银行股份有限公司开立的华宝兴业港股通恒生中国(香港上市)25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,本基金募集期间含本息共募集311,438,053.19份基金份额,其中场外认购的基金份额为112,235,434.19份;场内认购的基金份额为199,202,619.00份。

9、本基金募集备案情况

本基金于2017年4月18日验资完毕,2017年4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2017年4月20日获得《关于华宝兴业港股通恒生中国(香港上市)25指数证券投资基金(LOF)备案确认的函》(机构部函【2017】1003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:2017年4月20日

11、基金合同生效日的基金份额总额:311,438,053.19份

(二)本基金日常申购、赎回情况

本基金将于2017年5月8日开放日常申购、赎回业务,详细信息请投资者查阅刊登在2017年5月3日《上海证券报》及本公司网站(www.fsfund.com)上的《华宝兴业港股通恒生中国(香港上市)25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[2017]117号

2、上市交易日期:2017年5月8日

本基金自上市首日起实施“T+0”回转交易

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：香港大盘(基金代码：501301)

5、本次上市交易份额：199,202,619.00份（截至2017年4月28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 2017 年 4 月 28 日，本基金基金份额持有人总户数为 3,966 户，其中场内份额持有人户数为 2,014 户，平均每户持有的场内基金份额为 98,908.95 份；场外份额持有人户数为 1,952 户，平均每户持有的场外基金份额为 57,497.66 份。

（二）持有人结构

1、截至 2017 年 4 月 28 日，场内基金份额持有人结构如下：

截至 2017 年 4 月 28 日，本基金场内投资者持有基金份额 199,202,619.00 份。其中，场内机构投资者持有的基金份额为 21,062,439.00 份，占基金场内总份额的 10.57%；场内个人投资者持有的基金份额为 178,140,180.00 份，占基金场内总份额的 89.43%。

2、截至 2017 年 4 月 28 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	0

（三）截至 2017 年 4 月 28 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	招商证券股份有限公司	8,000,440.00	4.02%
2	华宝证券有限责任公司	7,999,000.00	4.02%
3	陈国南	2,999,540.00	1.51%
4	上海拾晖资产管理有限公司一拾晖稳健一号私募证券投资基金	2,976,186.00	1.49%
5	魏松江	2,098,773.00	1.05%
6	董文庆	2,000,890.00	1.00%

7	许勇	1,999,540.00	1.00%
8	秦春德	1,999,540.00	1.00%
9	邱运凤	1,999,360.00	1.00%
10	关键铤	1,999,360.00	1.00%

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：华宝兴业基金管理有限公司

法定代表人：郑安国

总经理：HUANG Xiaoyi Helen（黄小慧）

注册资本：人民币 1.5 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：310000400334472

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，外方股东法国领先资产管理有限公司持有 49%的股份。

2、内部组织结构及职能

公司下设 25 个部门，包括：国内投资部、固定收益部、机构投资部、研究部、量化投资部、国际业务部、监察稽核部、风险管理部、北京分公司、深圳分公司、投资服务中心（中西部大区、北方大区、华南大区、华东大区）、机构及海外销售部、产品开发部、专户营销部、战略策划部、市场支持部、电子商务部、交易部、清算登记部、信息技术部、财务部、人事行政部。

各部门主要职责概述如下：

国内投资部：主要负责国内主动权益基金的投资管理。

固定收益部：主要负责固定收益产品的投资研究工作。

机构投资部：主要负责非公募产品的投资管理和投资咨询工作。

研究部：主要负责宏观经济、行业及上市公司研究。

量化投资部：主要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的部门。

国际业务部：主要负责 QDII 基金的投资研究工作。

监察稽核部：主要负责公司合规管控、反洗钱及内部稽核审计。

风险管理部：主要负责公司投资组合的风险评估并提供风险管理建议。

北京分公司：主要负责维护公司在北方地区机构销售。

深圳分公司：主要负责维护公司在南方地区机构销售。

机构及海外销售部：主要负责维护公司在华东地区机构销售。

投资服务中心：主要负责维护公司各大区域的渠道销售。

产品开发部：主要负责公司产品战略，开发各种基金品种。

专户营销部：主要负责向机构客户、高端个人客户和渠道销售特定资产管理产品（即专户产品）。

战略策划部：主要负责公司市场营销、品牌建设、营销宣传、公关维护、渠道规划、渠道开发与维护等业务，还负责公司市场人员的 KPI 考核、费用管理、市场部内部事务支持等工作。

市场支持部：主要负责 Call Center 的管理和客户服务工作。

电子商务部：主要负责公司基金电子直销业务。

交易部：主要负责所有投资组合的交易管理。

清算登记部：主要负责基金交易的资金调拨、交易清算；组织基金会计核算。

信息技术部：主要负责公司信息系统的系统开发和日常维护。

财务部：主要负责公司财务管理、会计核算和资金管理。

人事行政部：主要负责公司人力资源管理和行政管理。

信息披露负责人：刘月华；021-38505888

截至 2017 年 3 月 31 日，我公司共有员工 221 人，其中博士及博士以上有 6 人，硕士 124 人，本科 80 人，专科及以下 11 人。

3、基金管理业务情况

截至 2017 年 3 月 31 日，华宝兴业基金管理有限公司旗下共管理 54 只开放式基金，资产管理规模为 121,901,596,866.92 元。旗下管理的基金有华宝兴业宝康消费品证券投资基金、华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金、华宝兴业宝康债券投资基金、华宝兴业动力组合混合型证券投资基金、华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金、华宝兴业现金宝货币市场基金、华宝兴业收益增长混合型证券投资基金、华宝兴业先进成长混合型证券投资基金、华宝兴业行业精选混合型证券投资基金、华宝兴业大盘精选混合型证券投资基金、华宝兴业增

强收益债券型证券投资基金、华宝兴业中证 100 指数证券投资基金、华宝兴业海外中国成长混合型证券投资基金、上证 180 价值交易型开放式证券投资基金、华宝兴业上证 180 价值交易型开放式证券投资基金联接基金、华宝兴业新兴产业混合型证券投资基金、华宝兴业可转债债券型证券投资基金、上证 180 成长交易型开放式证券投资基金、华宝兴业上证 180 成长交易型开放式证券投资基金联接基金、华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF）、华宝兴业医药生物优选混合型证券投资基金、华宝兴业资源优选混合型证券投资基金、华宝兴业现金添益交易型货币市场基金、华宝兴业服务优选混合型证券投资基金、华宝兴业创新优选混合型证券投资基金、华宝兴业生态中国混合型证券投资基金、华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝兴业高端制造股票型证券投资基金、华宝兴业品质生活股票型证券投资基金、华宝兴业稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、华宝兴业事件驱动混合型证券投资基金、华宝兴业国策导向混合型证券投资基金、华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金、华宝兴业新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金、华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、华宝兴业万物互联灵活配置混合型证券投资基金、华宝兴业中国互联网股票型证券投资基金、华宝兴业转型升级灵活配置混合型证券投资基金、华宝兴业核心优势灵活配置混合型证券投资基金、华宝兴业标普美国品质消费股票指数证券投资基金(LOF)、华宝兴业宝鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金、华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)、华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金、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、华宝兴业新活力灵活配置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、华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、华宝兴业新起点灵活配置混合型证券投资基金、华宝兴业标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金(LOF)、华宝兴业新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、华宝兴业新飞跃灵活配置混合型证券投资基金、华宝兴业新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、华宝兴业新回报一年定期开放混合型证券投资基金。

4、本基金基金经理

周晶先生，经济学博士、工商管理硕士。先后在美国德州奥斯丁市德亚资本、泛太平洋证券（美国）和汇丰证券（美国）从事数量分析、另类投资分析和证券投资研究工作。2005 年至 2007 年在华宝兴业基金管理有限公司任内控审计风险管理部主管，2011 年再次加入华宝兴业基金管理有限公司任策略部总经理兼首席策略分析师，现任国际业务部总经理。2013 年 6 月至 2015 年 11 月任华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金基金经理，2014 年 9 月

起任华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)基金经理,2015年9月起任华宝兴业中国互联网股票型证券投资基金基金经理,2016年3月起任华宝兴业标普美国品质消费股票指数证券投资基金(LOF)基金经理,2016年6月起任华宝兴业标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)基金经理,2017年4月起任华宝兴业港股通恒生中国(香港上市)25指数证券投资基金(LOF)基金经理。

俞翼之先生,应用金融学硕士。先后在汇丰银行上海分行、凯基证券(上海)办事处、渣打银行上海分行、永丰金证券(上海)代表处、上海上元投资从事证券研究及投资工作。2011年加入华宝兴业基金管理有限公司任海外投资管理部基金经理助理,2017年4月起任华宝兴业港股通恒生中国(香港上市)25指数证券投资基金(LOF)基金经理。

(二) 基金托管人

一) 基本情况

名称:招商证券股份有限公司(简称“招商证券”)

住所:广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

办公地址:广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人:宫少林

成立日期:1993年8月1日

批准设立机关和批准设立文号:中国证监会证监基字[1999]11号

基金托管业务批准文号:证监许可[2014]78号

注册资本:人民币58.0814亿元

存续期间:持续经营

联系人:秦湘

联系电话:0755-26951111

招商证券是百年招商局旗下金融企业,经过二十多年创业发展,已成为拥有证券市场业务全牌照的一流券商,并经中国证券监督管理委员会评定为A类AA级券商。招商证券具有稳定的持续盈利能力、科学合理的风险管理架构、专业的服务能力。公司拥有多层次客户服务渠道,在北京、上海、广州、深圳等城市拥有200家批准设立的证券营业部和11家证券经纪业务管理分公司,同时在香港设有分支机构,全资拥有招商证券国际有限公司、招商期货有限公司、招商致远资本投资有限公司、招商证券投资有限公司、招商证券资产管理有限公司,参股博时基金管理公司、招商基金管理公司,构建起国内国际业务一体化的综合证券服务平台。招商证券致力于“全面提升核心竞争力,打造中国最佳投资银行”。公司将

越的金融服务实现客户价值增长，推动证券行业进步，立志打造产品丰富、服务一流、能力突出、品牌卓越的国际化金融机构，成为客户信赖、社会尊重、股东满意、员工自豪的优秀金融企业。

1、主要人员情况

招商证券托管部员工多人具备丰富的证券投资基金业务运作经验、会计师事务所审计经验，以及大型 IT 公司的软件设计与开发经验，人员专业背景覆盖了金融、会计、经济、计算机等各领域，其中本科以上学历占比 100%，高级管理人员均拥有硕士研究生或以上学历。

2、基金托管业务经营情况

招商证券托管部是国内首批获得证券投资基金托管业务的证券公司，可为各类公开募集资金设立的证券投资基金提供托管服务。托管部拥有独立的安全监控设施，稳定、高效的托管业务系统，完善的业务管理制度。招商证券托管部本着“诚实信用、谨慎勤勉”的原则，为基金份额持有人利益履行基金托管职责。除此之外，招商证券于 2012 年 10 月获得了证监会准许开展私募基金综合托管服务试点的正式批复，成为业内首家可从事私募托管业务的券商，经验丰富，服务优质，业绩突出。截至 2016 年一季度，招商证券共托管 15 只公募基金。

招商证券托管部于 2015 年 4 月通过了普华永道会计师事务所提供的 ISAE3402 鉴证服务，成为业内第一家通过 ISAE3402 认证的券商托管人和基金外包服务机构。

二）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

招商证券作为基金托管人：

(1) 托管业务的经营运作遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

(2) 建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，保持托管业务内部控制制度健全、执行有效。

(3) 防范和化解经营风险，提高经营管理效益，使托管业务稳健运行和受托资产安全完整，实现托管业务的持续、稳定、健康发展。

(4) 不断改进和完善内控机制、体制和各项业务制度、流程，提高业务运作效率和效果。

2、内部风险控制组织结构

招商证券股份有限公司经营管理层面设立了风险管理委员会。作为公司内部最高风险决

策机构，风险管理委员会负责审议公司风险管理政策、风险偏好、容忍度和经济资本等风险限额配置方案，拥有公司重大风险业务和创新业务项目的最终裁量权。风险管理部、法律合规部及稽核监察部为公司的风险管理职能部门。

资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内控稽核岗，配备专职监察稽核人员，在托管部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监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

招商证券托管部制定了各项管理制度和操作规程，建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，保持托管业务健全、有效执行；安全保管基金财产，保持基金财产的独立性；实行经营场所封闭式管理，并配备录音和录像监控系统；有独立的综合托管服务系统；业务管理实行复核和检查机制，建立了严格有效的操作制约体系；托管部树立内控优先和风险管理的理念，培养部门全体员工的风险防范和保密意识。

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

1、监督方法

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》等法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行监督，并及时提示基金管理人违规风险。

2、监督程序

基金托管人发现基金管理人投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在限期内及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，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。基金管理人对于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。

（三）验资机构

名称：德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址：中国上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼

办公地址：中国上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼

执行事务合伙人：曾顺福

联系电话：(021) 61418888

传真：(021) 63350177

联系人：曾浩

经办注册会计师：曾浩、吴凌志

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设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 2017 年 4 月 28 日的资产负债表如下：

资 产	本报告期末
	2017 年 4 月 28 日
资 产：	
银行存款	49,985,038.48
结算备付金	19,478,406.05
存出保证金	11,472,027.16
交易性金融资产	149,746,211.56
其中：股票投资	149,746,211.56
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
应收证券清算款	37,659.86
应收利息	113,081.59
应收股利	
应收申购款	
其他资产	
资产总计	330,832,424.70
负债和所有者权益	本报告期末
	2017 年 4 月 28 日
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	19,478,428.24
应付赎回款	

应付管理人报酬	51,211.40
应付托管费	10,242.29
应付销售服务费	
应付交易费用	119,894.11
应交税费	
应付利息	
应付利润	
其他负债	7,301.57
负债合计	19,667,077.61
所有者权益：	
实收基金	311,438,053.19
未分配利润	-272,706.10
所有者权益合计	311,165,347.09
负债和所有者权益总计	330,832,424.70

注：截至 2017 年 4 月 28 日，基金份额净值 0.9991 元，基金份额总额 311,438,053.19 份。

八、 基金投资组合

截至 2017 年 4 月 28 日，本基金的投资组合如下：

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	149,746,211.56	45.26
	其中：股票	149,746,211.56	45.26
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	100,000,000.00	30.23
	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	69,463,444.53	21.00
8	其他资产	11,622,768.61	3.51
9	合计	330,832,424.70	100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

截至 2017 年 4 月 28 日，本基金本报告期末未持有境内股票。

报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

截至 2017 年 4 月 28 日，本基金本报告期末未持有境内股票。

报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
能源	17,486,729.64	5.62
金融	105,201,658.58	33.81
信息技术	23,674,800.38	7.61
电信业务	1,469,608.56	0.47
房地产	1,913,414.40	0.61
合计	149,746,211.56	48.12

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

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	00700	腾讯控股	90,800.00	19,577,701.80	6.29
2	01398	工商银行	4,008,000.00	18,036,269.34	5.80
3	02318	中国平安	462,500.00	17,944,903.80	5.77
4	00939	建设银行	2,886,000.00	16,157,296.40	5.19
5	03988	中国银行	4,393,000.00	14,670,936.60	4.71
6	02628	中国人寿	663,000.00	13,889,926.91	4.46
7	00386	中国石化 工股份	2,354,000.00	13,137,184.37	4.22
8	01288	农业银行	1,849,000.00	5,880,126.19	1.89
9	02601	中国太保	220,400.00	5,613,125.16	1.80
10	02328	中国财险	400,000.00	4,436,286.72	1.43

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

截至 2017 年 4 月 28 日，本基金本报告期末未持有积极投资股票。

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

截至 2017 年 4 月 28 日，本基金本报告期末未持有债券投资。

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 2017 年 4 月 28 日，本基金本报告期末未持有债券投资。

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 2017 年 4 月 28 日，本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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 2017 年 4 月 28 日，本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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 2017 年 4 月 28 日，本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

截至 2017 年 4 月 28 日，本基金未投资股指期货。

本基金投资股指期货的投资政策

截至 2017 年 4 月 28 日，本基金未投资股指期货。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

截至 2017 年 4 月 28 日，本基金未投资国债期货。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

截至 2017 年 4 月 28 日，本基金未投资国债期货。

本期国债期货投资评价

截至 2017 年 4 月 28 日，本基金未投资国债期货。

投资组合报告附注

香港大盘基金截至 2017 年 4 月 28 日持仓前十名证券中的建设银行（0939.HK）于 2016 年 5 月 11 日收到甘肃证监局整改通知。因建设银行甘肃省分行营业部在基金销售过程中存在基金从业人员资质不符合法规要求以及销售适用性方面不符合法规要求的问题，责令其在 2016 年 5 月 31 日前予以改正并提交书面报告，等待组织检查验收。

香港大盘基金截至 2017 年 4 月 28 日持仓前十名证券中的中国人寿（2628.HK）于 2016 年 6 月 24 日收到中国保险监督管理委员会《中国保险监督管理委员会行政处罚决定书》。公司因采取退保金直接冲减退保年度保费收入的方式处理长期险非正常退保业务，违反了《中华人民共和国保险法》相关规定，决定罚款 40 万元。

本基金为指数证券投资基金，采用完全复制法进行指数化投资，按照成份股在恒生中国（香港上市）25 指数中的基准权重构建指数化投资组合。基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。本报告期内，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。

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。

其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	11,472,027.16
2	应收证券清算款	37,659.86
3	应收股利	

4	应收利息	113,081.59
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	11,622,768.61

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截至 2017 年 4 月 28 日，本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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 2017 年 4 月 28 日，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。

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 2017 年 4 月 28 日，本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限。

九、 重大事件揭示

本基金基金合同已于 2017 年 4 月 20 日正式生效，基金管理人已于 2017 年 4 月 21 日在《上海证券报》刊登《华宝兴业港股通恒生中国（香港上市）25 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，披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）在知悉可能对基金价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《证券投资基金法》、《证券投资基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

（二）根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，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、基金份额净值计算进行监督和核查；如发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，将及时通知基金管理人纠正；基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、 备查文件目录

(一) 本基金备查文件包括下列文件:

1、中国证监会准予华宝兴业港股通恒生中国(香港上市)25指数证券投资基金(LOF)募集注册的文件;

2、《华宝兴业港股通恒生中国(香港上市)25指数证券投资基金(LOF)基金合同》;

3、《华宝兴业港股通恒生中国(香港上市)25指数证券投资基金(LOF)托管协议》;

4、法律意见书;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、基金托管人业务资格批件、营业执照;

7、中国证监会要求的其他文件。

(二) 备查文件的存放地点和投资者查阅方式:

以上备查文件存放在基金管理人和基金托管人的办公场所,在办公时间可供免费查阅。

附件：基金合同摘要

(一) 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

(1) 依法募集资金；

(2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

(3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(4) 销售基金份额；

(5) 按照规定召集基金份额持有人大会；

(6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

(10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资及转融通；

(14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换等业务的业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

(13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合

理成本的条件下得到有关资料的复印件；

(18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

(23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

3、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

4、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，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；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户，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；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 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，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

(17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会，并通知基

金管理人；

(19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

5、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法申请赎回或转让其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；

(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(7) 监督基金管理人的投资运作；

(8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

6、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

(1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；

(2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

(3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

(5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

(6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。本基金份额持有人大会不设日常机构。

1、召开事由

(1) 当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，法律法规、中国证监会另有规定的除外：

1) 终止《基金合同》；

2) 更换基金管理人；

3) 更换基金托管人；

4) 转换基金运作方式；

5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

6) 变更基金类别；

7) 本基金与其他基金的合并；

8) 变更基金投资目标、范围或策略；

9) 变更基金份额持有人大会程序；

10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

13) 终止上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外；

14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

(2) 在不违背法律法规规定和《基金合同》约定且对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

2) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内且对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式;

3) 因相应的法律法规、上海证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动而对《基金合同》进行修改;

4) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化;

5) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、会议召集人及召集方式

(1) 除法律法规规定或《基金合同》另有约定外, 基金份额持有人大会由基金管理人召集。

(2) 基金管理人未按规定召集或不能召集时, 由基金托管人召集。

(3) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的, 应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集, 并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的, 应当自出具书面决定之日起 60 日内召开; 基金管理人决定不召集, 基金托管人仍认为有必要召开的, 应当由基金托管人自行召集, 并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人, 基金管理人应当配合。

(4) 代表基金份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会, 应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集, 并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的, 应当自出具书面决定之日起 60 日内召开; 基金管理人决定不召集, 代表基金份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人仍认为有必要召开的, 应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集, 并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人; 基金托管人决定召集的, 应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人, 基金管理人应当配合。

(5) 代表基金份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会, 而基金管理人、基金托管人都不召集的, 代表基金份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人有权自行召集, 并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的, 基金管理人、基金托管人应当配合, 不得阻碍、干扰。

(6) 基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

(1) 召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点和会议形式；
- 2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- 3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- 4) 授权委托证明的内容要求(包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点；
- 5) 会务常设联系人姓名及联系电话；
- 6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- 7) 召集人需要通知的其他事项。

(2) 采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。

(3) 如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

4、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式等法律法规和监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

(1)现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。

若到会者在权益登记日代表的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

(2) 通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以会议通知载明的形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1) 会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人(如果基金托管人为召集人，则为基金管理人)到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人，则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

3) 本人直接出具意见或授权他人代表出具意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。

若本人直接出具意见或授权他人代表出具意见基金份额持有人所持有基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具意见或授权他人代表出具意见；

4) 上述第 3) 项中直接出具意见的基金份额持有人或受托代表他人出具意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

(3) 在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，本基金可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

5、议事内容与程序

(1) 议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

(2) 议事程序

1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第 7 条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

6、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

(1) 一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第（2）项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

(2) 特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、与其他基金合并以特别决议通过方为

有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时监督员及公证机关均认为有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

7、计票

(1) 现场开会

1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

4) 计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

(2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

8、生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

9、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

（三）基金收益分配原则、执行方式

1、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

2、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

3、基金收益分配原则

（1）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配；

（2）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在证券登记系统基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

（3）每一基金份额享有同等分配权；

（4）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

4、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

5、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

6、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

（四）与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

1、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、仲裁费和诉讼费；
- （6）基金份额持有人大会费用；
- （7）基金的证券/期货交易费用；
- （8）基金的银行汇划费用；
- （9）账户开户费用和账户维护费；
- （10）基金上市费用和年费；
- （11）因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- （12）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。

（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 0.75% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，

基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

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 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

3、标的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数许可使用协议的约定计提标的指数许可使用费，基金合同生效后的标的指数许可使用费从基金财产中列支。标的指数许可使用费的具体费率、计算方式及支付方式详见招募说明书。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒介进行公告。

上述“1、基金费用的种类”中第（4）—（12）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。

（五）基金财产的投资方向和投资限制

1、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，包括标的指数成份股、备选成份股、依法发行上市的其他股票（包括港股通标的股票和中国证监会核准发行上市的股票）、债券（国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。

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。

基金的投资组合比例为：

本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

本基金通过港股通投资标的指数的成份股、备选成份股，未来如果港股通业务规则发生变化或出现法律法规或监管部门允许投资的其他模式，基金管理人可在履行适当程序后相应调整。

2、投资限制

（1）组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

1) 本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；

2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；

3) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

4) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

5) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

6) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

7) 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%；

8) 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%；

9) 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%；

10) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月

内予以全部卖出；

11) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

12) 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%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不展期；

13) 本基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：

i) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；

ii) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

iii) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

iv) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

vi) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

14) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；

15) 本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；

16) 本基金参与转融通证券出借业务的，在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的50%，证券出借的平均剩余期限不得超过30天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

17) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资；

18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第10)项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同

的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

（2）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- 1) 承销证券；
- 2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- 3) 从事承担无限责任的投资；
- 4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- 5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- 6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管机构取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

（六）基金资产净值的计算方法和公告方式

1、基金资产净值的计算方法

基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值。

2、基金资产净值的公告方式

基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，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。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。

基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

（七）基金合同解除和终止的事由、程序

1、《基金合同》的变更

（1）变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

（2）关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议生效后方可执行，自决议生效后两日内在指定媒介公告，并在决议生效后5日内报中国证监会备案。

2、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

（1）基金份额持有人大会决定终止的；

（2）基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

（3）《基金合同》约定的其他情形；

（4）相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

3、基金财产的清算

（1）基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

（4）基金财产清算程序：

1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；

3) 对基金财产进行估值和变现；

4) 制作清算报告；

5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律

意见书；

6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

7) 对基金剩余财产进行分配。

(5) 基金财产清算的期限为 6 个月。

4、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

5、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

6、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

7、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

(八) 争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交华南国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为深圳市，按照华南国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。

(九) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。