

华宝兴业标普美国品质消费股票指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书 (更新) 摘要

2017 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：中国建设银行股份有限公司

【重要提示】

本基金根据 2015 年 5 月 21 日中国证券监督管理委员会《关于准予华宝兴业标普美国品质消费股票指数证券投资基金（LOF）注册的批复》（证监许可〔2015〕955 号）和 2016 年 1 月 20 日《关于华宝兴业标普美国品质消费股票指数证券投资基金（LOF）延期募集备案的回函》（机构部函〔2016〕126 号）进行募集。

基金管理人保证《华宝兴业标普美国品质消费股票指数证券投资基金(LOF)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注册,但中国证监会对本基金募集的注册,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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金主要投资于美国证券市场,基金净值会因为美国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:政治风险、海外市场风险、政府管制风险、汇率风险、法律风险、利率风险、税务风险、境外上市公司经营风险,开放式基金的一般风险,如:流动性风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险、交易对手的信用风险、大宗交易风险等。另外,本基金为指数基金,其特定风险包括指数化投资的风险、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、标的指数编制的风险、跟踪误差的风险、标的指数变更的风险、股指期货及其他衍生品投资的风险等。本基金为股票型基金,预期风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。

投资有风险,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等信息披露文件,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应,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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,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。

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。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险,由投资者自行承担。

本招募说明书摘要所载内容截止日为 2017 年 9 月 18 日,有关财务数据和净值表现数据截止日为 2017 年 6 月 30 日,财务数据未经审计。

一、基金合同生效日

本基金基金合同生效日: 2016 年 3 月 18 日

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: 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 亿元人民币

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。现任华宝兴业基金管理有限公司董事长、华宝投资有限公司副总经理、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的工作；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，本科。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、总经理及其他高级管理人员

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。

Alexandre Werno 先生，常务副总经理，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

周晶先生，经济学博士、MBA，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月起兼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月兼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月兼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。

5、权益投资决策委员会成员

刘自强先生，投资总监、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、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。

闫旭女士，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、华宝兴业智慧产业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。

蔡目荣先生，国内投资部副总经理、华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金基金经理、华宝兴业资源优选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）基金管理人职责

基金管理人应严格依法履行下列职责：

- 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、办理本基金备案手续；

- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照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收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、按照规定召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、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者实施其他法律行为；
- 12、中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人承诺

1、基金管理人将遵守《基金法》、《中华人民共和国证券法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行为的发生。

2、基金管理人不得有下列行为：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）侵占、挪用基金财产；
- （6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （7）玩忽职守，不按照规定履行职责；
- （8）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金经理承诺

- （1）依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- （2）不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；
- （3）不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投

资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(五) 基金管理人内部控制制度

1、风险管理体系

本基金在运作过程中面临的风险主要包括政治风险、海外市场风险、政府管制风险、汇率风险、法律风险、利率风险、税务风险、境外上市公司经营风险，开放式基金的一般风险，如：流动性风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险、交易对手的信用风险、大宗交易风险等。本基金特定风险包括指数化投资的风险、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、标的指数编制的风险、跟踪误差的风险、标的指数变更的风险、股指期货及其他衍生品投资的风险等。

针对上述各种风险，基金管理人建立了一套完整的风险管理体系，具体包括以下内容：

(1) 搭建风险管理环境。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。辨识公司运作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归类。

(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级别，每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别进入相应的级别。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，但仍加以定期监控，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) 监视与检查。对已有的风险管理系统进行实时监视，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) 报告与咨询。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，并寻求咨询意见。

2、内部控制制度

(1) 内部风险控制原则

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、反馈等各个环节；

有效性原则。通过设置科学清晰的操作流程，结合程序控制，建立合理的内控程序，维护内部控制制度的有效执行；

独立性原则。公司必须在精简高效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、市场营销等相关部门，应当在物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，尽量降低经营运作成本，保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果；

合法合规性原则。公司内控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各个环节，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、政策制度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、建立完整的信息资料保全系统、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。督察长的任免须报中国证监会核准。

督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告，并在董事会及董事会下设的相关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问题时，应当及时告知公司总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；公司总经理对存在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）监察稽核及风险管理制度

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控制度的健全性、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的情况；评价各项内控制度执行的有效性，对内控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；负责包括基金经理离任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制度的声明书

- （1）基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- （2）基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人发展不断完善内部控制制度。

三、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

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：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2017年6月末，本集团资产总额216,920.67亿元，较上年末增加7,283.62亿元，增幅3.47%。上半年，本集团实现利润总额1,720.93亿元，较上年同期增长1.30%；净利润较上年同期增长3.81%至1,390.09亿元，盈利水平实现平稳增长。

2016年，本集团先后获得国内外知名机构授予的100余项重要奖项。荣获《欧洲货币》“2016中国最佳银行”，《环球金融》“2016中国最佳消费者银行”、“2016亚太区最佳流动性管理银行”，《机构投资者》“人民币国际化服务钻石奖”，《亚洲银行家》“中国最佳大型零售银行奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构奖”。本集团在英国《银行家》2016年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第2；在美国《财富》2016年世界500强排名第22位。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管

业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原珩，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2017 年二季度末，中国建设银行已托管 759 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行连续 11 年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》“中国最佳托管银行”、“中国最佳次托管银行”、“最佳托管专家——QFII”等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”。

二、基金托管人的内部控制制度

（一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

（二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

（三）内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施

音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

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

（一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

（二）监督流程

1.每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

2.收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

3.根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性和投资独立性等方面进行评价，报送中国证监会。

4.通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

四、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、场外发售机构

（1）直销机构

1) 直销柜台

华宝兴业基金管理有限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：孔祥清

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

直销柜台传真：021-50499663、50988055

网址：www.fsfund.com

2) 直销 e 网金

投资者可以通过华宝兴业基金管理有限公司网上交易直销 e 网金系统办理本基金的认/申购、赎回等业务，具体交易细则请参阅华宝兴业基金管理有限公司网站公告。网上交易网址：www.fsfund.com。

(2) 其他销售机构

1) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：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

客户电话：95533

公司网址：www.ccb.com

2) 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

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

客户电话：95588

公司网址：www.icbc.com.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

客户电话：95599

公司网址：www.95599.cn

4) 中国银行股份有限公司

注册地址：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

客户电话：95566

公司网址：www.boc.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

联系人：曹榕

联系电话：(021) 58781234

传真：(021) 58408483

客户电话：95559

公司网址：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

联系人：邓炯鹏

联系电话：0755-83198888

客户电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

7) 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

客户电话：95561 或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址：<http://www.cib.com.cn>

8) 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

联系人：杨成茜

联系电话：010-58560666

传真：010-57092611

客户电话：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

9) 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

客户电话：95541

公司网址：www.cbhb.com.cn

10) 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

客户电话：800-830-8003；400-830-8003

公司网址：www.gdb.com.cn

11) 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

客户电话：95577

公司网址：www.hxb.com.cn

12) 江苏银行股份有限公司

注册地址：南京市洪武北路 55 号

客户电话：96098，40086-96098

公司网址：www.jsbchina.cn

13) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号

联系人：张莉

联系电话：021-38637673

传真：021-50979507

客户电话：95511-3

公司网址：bank.pingan.com

14) 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

联系人：高天、姚磊

联系电话：021-61618888

传真：021-63604196

客户电话：95528

公司网址：www.spdb.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

联系人：陈春林

客户电话：95580

公司网址：www.psbc.com

16) 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 9 号

客户电话：95558

公司网址：bank.ecitic.com

17) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼

联系人：陈剑虹

联系电话：0755-82558323

传真：0755-82558355

客户电话：4008-001-001

公司网址：www.essence.com.cn

18) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

联系人：蔡霆

联系电话：022-28451991

传真：022-28451958

客户电话：4006515988

公司网址：<http://www.bhzq.com>

19) 长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

联系人：金夏

联系电话：021-62821733

客户电话：0755-33680000、400 6666 888

公司网址：www.cgws.com

20) 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：奚博宇

联系电话：027-65799999

传真：027-85481900

客户电话：95579 或 4008-888-999

公司网址: www.95579.com

21) 北京创金启富投资管理有限公司

注册地址: 北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

办公地址: 北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

联系人: 李婷婷

联系电话: 400-6262-818

传真: 010-63583991

客户电话: 010-66154828-8038

公司网址: www.5irich.com

22) 上海大智慧财富管理有限公司

注册地址: 上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 层

办公地址: 上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 层

联系人: 施燕华

联系电话: 021-20219966

传真: 021-20219923

客户电话: 021-20219931

公司网址: <https://8.gw.com.cn/>

23) 德邦证券股份有限公司

注册地址: 上海市普陀区曹阳路 510 号南半幢 9 楼

办公地址: 上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼

联系人: 朱磊

联系电话: 862168761616-8507

传真: 862168767981

客户电话: 400-8888-128

公司网址: www.tebon.com.cn

24) 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

联系电话: 0431-85096517

传真: 0431-85096795

客户电话：95360

公司网址：www.nesc.cn

25) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25 层-29 层

联系人：胡月茹

联系电话：021-63325888

传真：021-63326729

客户电话：95503

公司网址：www.dfzq.com.cn

26) 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

联系人：王一彦

联系电话：021-20333333

传真：021-50498825

客户电话：95531；400-8888-588

公司网址：www.longone.com.cn

27) 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：方晓丹

联系电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

客户电话：95330

公司网址：<http://www.dwzq.com.cn>

28) 东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

联系人：汤漫川

联系电话：010-66555316

传真：010-66555246

客户电话：400-8888-993

公司网址: www.dxzq.net.cn

29) 方正证券股份有限公司

注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

办公地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

客户电话: 95571

公司网址: www.foundersc.com

30) 光大证券股份有限公司

注册地址: 上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址: 上海市静安区新闻路 1508 号

联系人: 刘晨、李芳芳

联系电话: 021—22169999

传真: 021—22169134

客户电话: 95525、4008888788、10108998

公司网址: www.ebscn.com

31) 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: 广东省广州天河区大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44

楼

联系人: 黄岚

客户电话: 95575 或致电各地营业网点

公司网址: www.gf.com.cn

32) 国都证券股份有限公司

注册地址: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

客户电话: 400-818-8118

公司网址: www.guodu.com

33) 国海证券股份有限公司

注册地址: 广西桂林市辅星路 13 号

办公地址: 广西南宁市滨湖路 46 号

联系人: 牛孟宇

联系电话: 0755-83709350

传真：0755-83704850

客户电话：95563

公司网址：<http://www.ghzq.com.cn>

34) 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：罗春蓉、陈曦、康楠

联系电话：010-65051166

传真：010-65058065

客户电话：400-910-1166

35) 国金证券股份有限公司

办公地址：四川省成都市东城根上街95号

联系人：刘婧漪、贾鹏

联系电话：028-86690057、028-86690058

传真：028-86690126

客户电话：95310

公司网址：www.gjzq.com.cn

36) 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：400-888-6628

客户电话：95521

公司网址：www.gtja.com

37) 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：周杨

联系电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客户电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

38) 国元证券股份有限公司

注册地址：合肥寿春路 179 号

客户电话：4008888777 或 95578

公司网址：www.gyzq.com.cn

39) 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：李笑鸣

联系电话：021-23219000

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

40) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

联系人：陆敏

联系电话：400-700-9665

传真：021-68596919

客户电话：021-20613600

公司网址：www.ehowbuy.com

41) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

联系人：刘洋

联系电话：400-920-0022

传真：021-20835788

客户电话：021-20835879

公司网址：www.licaike.com

42) 恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

联系人：王旭华

联系电话：0471-4972343

客户电话：400-196-6188

公司网址：www.cnht.com.cn

43) 华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座

联系电话：0551-65161666

传真：0551-65161600

客户电话：95318、400-809-6518（全国）

公司网址：www.hazq.com

44) 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：021-68777222

传真：021-68777822

客户电话：400-820-9898，021-38929908

公司网址：<http://www.cnhbstock.com>

45) 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

客户电话：96326（福建省外请加拨 0591）

公司网址：www.hfzq.com.cn

46) 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：庞晓芸

联系电话：0755-82492193

传真：0755-82492962

客户电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

47) 江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

联系人：周俊

联系电话：0451-85863726

传真：0451-82337279

客户电话：400-666-2288

公司网址：www.jhzq.com.cn

48) 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

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

联系人：文雯

联系电话：400-166-1188

传真：010-83363099

客户电话：010-83363010

公司网址：<http://8.jrj.com.cn>

49) 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

办公地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

联系人：赵德赛

联系电话：4000988511

传真：010-89188000

客户电话：4000988511

公司网址：<http://kenterui.jd.com>

50) 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

联系人：兰敏

联系电话：4000-466-788

传真：021-52975270

客户电话：021-52822063

公司网址：www.66zichan.com

51) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

联系人：程晨

联系电话：4008219031

传真：021-50783597

客户电话：021-20665952

公司网址：www.lufunds.com

52) 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

联系人：赵明

联系电话：010-85127622

传真：010-85127917

客户电话：400-619-8888

公司网址：www.msza.com

53) 中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼

客户电话：4008895618

公司网址：<http://www.e5618.com>

54) 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

联系人：方成

联系电话：021-38609777

客户电话：400-821-5399

公司网址：www.noah-fund.com

55) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 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：周一涵

传真：0755-82435367

客户电话：95511-8

公司网址：www.stock.pingan.com

56) 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

客户电话：400-666-1618、95573

公司网址：www.i618.com.cn

57) 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：021-53686888

传真：021-53686100，021-53686200

客户电话：021-962518

公司网址：www.962518.com

58) 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：021-33389888

传真：021-33388224

客户电话：95523 或 4008895523

公司网址：www.swhysc.com

59) 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

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

联系人：王怀春

联系电话：0991-2307105

传真：0991-2301927

客户电话：400-800-0562

公司网址：www.hysec.com

60) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

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

联系人：韩爱彬

联系电话：4000-776-123

传真：0571-26697013

客户电话：021-60897840

公司网址：<http://www.fund123.cn/>

61) 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

联系人：鄢萌莎

联系电话：0755-33376922

客户电话：4006-877-899

公司网址：www.tenyuanfund.com

62) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

联系人：杨蕾

联系电话：400-1818-188

传真：021-64385308

客户电话：021-54509998

公司网址：www.1234567.com.cn

63) 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

办公地址: 浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

联系人: 董一锋

联系电话: 4008-773-772

传真: 0571-86800423

客户电话: 0571-88911818

公司网址: www.5ifund.com

64) 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

办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

联系电话: 400-821-0203

传真: 021-6888 2281

客户电话: 021-51327185

65) 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: 重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

联系人: 张煜

传真: 023-63786212

客户电话: 4008-096-096

公司网址: www.swsc.com.cn

66) 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

办公地址: 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

联系人: 付文红

联系电话: 010-62675979

传真: 010-62675369

客户电话: 010-62675369

公司网址: www.xincai.com

67) 信达证券股份有限公司

办公地址: 北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼信达金融中心

联系人: 尹旭航

联系电话: 010-63081493

传真: 010-63081344

客户电话: 400-800-8899、95321

公司网址: www.cindasc.com

68) 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: 夏中苏

联系电话: 0591-38281963

客户电话: 95562

公司网址: www.xyzq.com.cn

69) 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

办公地址: 北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

联系人: 宋欣怡

联系电话: 400-6099-200

传真: 010-85894285

客户电话: 010-52855713

公司网址: www.yixinfund.com

70) 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: 邓颜

联系电话: 010-66568292

客户电话: 95551、400-8888-888

公司网址: www.chinastock.com.cn

71) 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：黄婵君

联系电话：0755-82943666

客户电话：4008888111、95565

公司网址：www.newone.com.cn

72) 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：戴蕾

联系电话：0791-86768681

客户电话：400-8866-567

公司网址：www.avicsec.com

73) 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

办公地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼 1 层

联系人：陶涛

联系电话：400-600-0030

传真：010-68292941

客户电话：010-68292745

公司网址：www.bzfunds.com

74) 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：吴阳

联系电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客户电话：95538

公司网址：www.zts.com.cn

75) 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

公司网址：www.china-invs.cn

76) 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 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

联系人：权唐

联系电话：400-889-5548

客户电话：400-8888-108(免长途费)、95587

公司网址：www.csc108.com

77) 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

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

联系人：洪诚

联系电话：0755-23953913

传真：0755-83217421

客户电话：400-990-8826

公司网址：www.citicsf.com

78) 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：顾凌

联系电话：010-60838888

传真：010-60833739

客户电话：95548

公司网址：www.cs.ecitic.com

79) 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：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

联系人：赵艳青

联系电话：0532-85023924

传真：0532-85022605

客户电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

80) 中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

传真：021-50372474

客户电话：4006208888 或各地营业网点咨询电话

公司网址：www.bocichina.com

81) 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

联系人：童彩平

联系电话：400-678-8887

传真：0755-33227951

客户电话：0755-33227950

公司网址：www.zlfund.cn

82) 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

联系人：李孟军

联系电话：020-89629066

传真：020-89629011

客户电话：020-89629099

公司网址：www.yingmi.cn

83) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

公司网址：<https://danjuanapp.com/>

客服电话：4000618518

电话：010-61840688

传真：010-61840699

84) 深圳前海微众银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市南山区田厦金牛广场 A 座 36 楼、37 楼

注册资本：42 亿元人民币

法定代表人：顾敏

公司网站：www.webank.com

客户服务电话：4009998800

85) 上海华夏财富投资管理有限公司

公司网址：www.amcfortune.com

客户服务电话：400-817-5666

86) 国联证券股份有限公司

公司地址：无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦

客户服务：95570

网址：<http://www.glsc.com.cn>

2、场内发售机构

本基金场内将通过深圳证券交易所内具有基金销售业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位发售。本基金认购期结束前获得基金销售业务资格的证券公司也可代理场内基金份额的发售。尚未取得基金销售业务资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可在本基金份额上市后，通过深圳证券交易所交易系统办理本基金份额的上市交易。

(二) 登记机构

本基金人民币份额的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，美元份额的登记机构为华宝兴业基金管理有限公司。

1、名称：中国证券登记结算有限责任公司

地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系人：朱立元

电话：010-59378839

传真：010-59378907

2、名称：华宝兴业基金管理有限公司

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

电话：021-38505888

传真：021-38505777

联系人：章希

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

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：俞卫锋

联系电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：孙睿

经办律师：黎明、孙睿

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址：上海市延安东路222号外滩中心30楼

办公地址：上海市延安东路222号外滩中心30楼

负责人：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

五、基金的名称

本基金名称：华宝兴业标普美国品质消费股票指数证券投资基金（LOF）

六、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

七、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最小化。正常情况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不得超过 5%。

八、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成分股、备选成分股、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的公募基金(包括 ETF)、已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的其他股票、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具、回购、证券借贷、跟踪同一标的指数的股指期货等金融衍生品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)。

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：

投资于标的指数成分股、备选成分股的资产不低于基金资产的 80%，投资于跟踪同一标的指数的公募基金(包括 ETF)的比例不超过基金资产净值的 10%。本基金持有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%。

九、基金的投资策略

本基金原则上采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况(如股票停牌、流动性不足)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将使用其他合理方法进行适当的替代,追求尽可能贴近目标指数的表现。

本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标的指数相关的公募基金(包括 ETF),以优化投资组合的建立,达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。

本基金在投资的过程中,造成跟踪误差的原因主要有以下几方面:

- 1、基金日常运作过程中必须保有一定比例的现金资产;
- 2、基金投资组合的权重与目标指数的成份股的权重可能在调整周期当中出现不一致;
- 3、基金补券过程中股票买卖价格与股票收盘价存在差异;
- 4、各种交易费用及基金运作过程中所产生的费用和开支;
- 5、成份股红利再投资等。

基金管理人会定期对跟踪误差进行归因分析,为基金投资组合下一步的调整及跟踪目标指数偏离风险的控制提供量化决策依据。同时,为更好地实现本基金的投资目标,本基金还将在条件允许的情况下,适当开展证券借贷业务,以期降低跟踪误差水平。

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要,将适当投资于债券和货币市场工具,固定收益投资的目的是在保证基金资产流动性的同时有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。

同时,为更好地实现本基金的投资目标,本基金还将在条件允许的情况下,开展证券借贷业务以及投资于股指期货等金融衍生品,以期降低跟踪误差水平。本基金投资于金融衍生品的目标是替代跟踪标的指数的成份股,使基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数。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。

正常情况下,本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%, 年化跟踪误差不超过 5%。

未来,随着全球证券市场投资工具的发展和丰富,本基金可相应调整和更新相关投资策略,并在更新的招募说明书中公告。

十、基金的业绩比较基准

本基金的标的指数为标普美国品质消费股票指数 (S&P Consumer Discretionary Select

Sector Index)。

本基金的业绩比较基准为经人民币汇率调整的标普美国品质消费股票指数收益率×95%+人民币活期存款利率（税后）×5%。

如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权，或标的指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为标的指数不宜继续作为跟踪标的，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。若变更标的指数、业绩比较基准对基金投资范围和投资策略等无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。若变更业绩比较基准、标的指数涉及本基金投资范围或投资策略等实质性变更，则基金管理人应就变更业绩比较基准、标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案。

十一、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

十二、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 2017 年 6 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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	130,886,675.13	94.03
	其中：普通股	130,886,675.13	94.03
	优先股	-	0.00
	存托凭证	-	0.00
	房地产信托凭证	-	0.00
2	基金投资	72,862.74	0.05

3	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
	其中：远期	-	0.00
	期货	-	0.00
	期权	-	0.00
	权证	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	货币市场工具	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	7,939,364.54	5.70
8	其他资产	299,188.97	0.21
9	合计	139,198,091.38	100.00

2、报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
美国	130,886,675.13	95.54
合计	130,886,675.13	95.54

3、报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

（1）报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
材料	-	-
工业	-	-
非日常生活消费品	130,886,675.13	95.54
日常消费品	-	-
保健	-	-
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
合计	130,886,675.13	95.54

（2）报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资。

4、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及存托凭证投资明细

（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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克	美国	3,007	19,718,760.93	14.39
2	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特公司	CMCS A US	纳斯达克	美国	35,882	9,460,635.49	6.91
3	HOME DEPOT INC	家得宝公司	HD US	纽约	美国	9,065	9,420,284.18	6.88
4	WALT DISNEY CO/THE	华特迪士尼	DIS US	纽约	美国	11,030	7,939,173.40	5.80
5	MCDONALDS CORP	麦当劳	MCD US	纽约	美国	6,179	6,411,127.14	4.68
6	PRICELINE GROUP INC/THE	Priceline 集团	PCLN US	纳斯达克	美国	373	4,726,525.71	3.45
7	STARBUCKS CORP	星巴克	SBUX US	纳斯达克	美国	10,980	4,337,267.60	3.17
8	NIKE INC -CL B	耐克公司	NKE US	纽约	美国	10,048	4,016,081.10	2.93
9	TIME WARNER INC	时代华纳	TWX US	纽约	美国	5,880	3,999,678.92	2.92
10	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	Charter Communications 公司	CHTR US	纳斯达克	美国	1,635	3,730,999.11	2.72

(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及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资。

5、报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

6、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

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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	SPDR-CONS DISCRE	ETF 基金	开放式	SSGA Funds Management Inc	72,862.74	0.05

10、投资组合报告附注

(1) 基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

(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(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	96,921.68
4	应收利息	134.92
5	应收申购款	202,132.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	299,188.97

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、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

(1) 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(2) 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

本基金本报告期末未持有积极投资。

十三、基金的业绩

基金业绩截止日为 2017 年 6 月 30 日，所列数据未经审计。

1、净值增长率与同期比较基准收益率比较：

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
2016/03/18-2016/12/31	10.10%	0.71%	10.99%	0.74%	-0.89%	-0.03%
2017/01/01-2017/06/30	7.08%	0.54%	7.26%	0.54%	-0.18%	0.00%
2016/03/18-2017/06/30	17.90%	0.65%	19.05%	0.67%	-1.15%	-0.02%

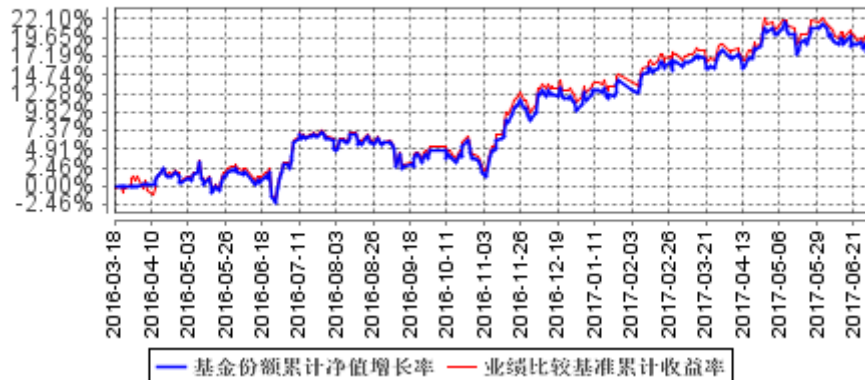
2、自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较：

华宝兴业标普美国品质消费股票指数证券投资基金（LOF）

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2016 年 3 月 18 日至 2017 年 6 月 30 日）

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至 2016 年 9 月 18 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

十四、基金的费用

(一) 与基金运作有关的费用

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，含境外托管代理行收取的费用；
- (3) 标的指数使用相关费用；
- (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、税务顾问费和诉讼费；
- (6) 基金份额持有人大会费用；
- (7) 基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于在境外市场开户、交易、清算、登记、存管等各项费用）；
- (8) 基金的银行汇划费用和外汇兑换交易的相关费用；
- (9) 基金依照有关法律法規应当缴纳的、购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息、罚金及费用）以及相关手续费、汇款费、基金的税务代理费；
- (10) 基金的开户费用、账户维护费用；
- (11) 除基金管理人和基金托管人因自身原因而导致的更换基金管理人、更换基金托管人及基金资产由原任基金托管人转移至新任基金托管人以及由于境外托管人更换导致基金资产转移所引起的费用；
- (12) 为应付赎回和交易清算而进行临时借款所发生的费用；
- (13) 基金的上市费用；
- (14) 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。

2、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 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在次月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。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0.25%的年费率计提。境外托管人的托管费从基金托管人的托管费中扣除。托管费的计算方法如下:

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在次月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

(3) 标的指数使用相关费用

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使用相关费用,基金合同生效后的标的指数使用相关费用从基金财产中列支。本基金的标的指数使用相关费用包括标的指数许可使用费和标的指数数据使用费。

1) 标的指数许可使用费

标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的指数许可使用费

E为前一日的基金资产净值

若任一年度累计计提指数许可使用费金额按年度最后一日(如为节假日取最近一日)中国人民银行或其授权机构公布的汇率中间价折算的金额小于指数许可使用协议规定的年度费用下限,则基金于该年度最后一日补提标的指数许可使用费至指数使用许可协议规定的费用收取下限,本基金标的指数许可使用费收取下限为每年30,000美元。

2) 标的指数数据使用费

标的指数数据使用费每日计提,每年6,000美元。计算方法如下:

$$H=6,000 \times \text{中国人民银行公布的人民币兑美元汇率中间价} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的指数数据使用费

标的指数数据使用费每日以人民币计提,按年度支付。若由于汇率影响当年计提的标的

指数数据使用费高于或低于 6,000 美元，则基金与该年度最后一日调整计提的数据使用费至 6,000 美元。

经基金管理人和基金托管人核对一致后，由基金管理人向基金托管人发送标的指数许可使用费和标的指数数据使用费划付指令，基金托管人于次年首日起 15 日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据指数许可使用协议所规定的方式支付给标的指数许可方。

如果指数许可使用协议约定的指数许可使用费和指数数据使用费的计算方法、费率和支付方式发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费和指数数据使用费。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，此项调整无须召开基金份额持有人大会。

上述“1、基金费用的种类中第（4）—（14）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。

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调低基金管理费率和基金托管费率。基金管理人应按照《信息披露办法》的规定在指定媒介上公告。

3、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；

（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。

4、基金税收

基金根据国家法律法规和基金投资所在地的法律法规规定，履行纳税义务。基金管理人对于最终税务的处理的真实准确负责。

基金份额持有人根据中国法律法规规定，履行纳税义务。

除因基金管理人或基金托管人疏忽、故意行为导致的基金在税收方面造成的损失外，基金管理人和基金托管人不承担责任。

本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规和境外市场的规定执行。

（二）与基金有关的销售费用

1、申购费用

投资者在一天之内如有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

(1) 人民币份额申购费用

本基金人民币份额的场外申购费率如下，场内申购费率由场内销售机构参照场外申购费率执行。

申购金额(M)(人民币)	申购费率
M<100 万元	1.20%
100 万元≤M<200 万元	0.80%
200 万元≤M<500 万元	0.40%
M≥500 万元	按笔收取，1000 元/笔

(2) 美元份额申购费用

本基金美元份额的场外申购费率如下。

申购金额(M)(美元)	申购费率
M<10 万美元	1.20%
10 万美元≤M<30 万美元	0.80%
30 万美元≤M<60 万美元	0.40%
M≥60 万美元	按笔收取，200 美元/笔

申购费用由投资者承担，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用，不列入基金财产。

2、赎回费用

本基金人民币份额的场内赎回费率为 0.5%。本基金人民币份额和美元份额的场外赎回费率表如下：

持有基金份额期限(Y)	赎回费率
Y<1 年	0.50%
1 年≤Y<2 年	0.25%
Y≥2 年	0

注：1 年指 365 日，2 年为 730 日

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费的 25%应当归入基金财产，其余用于支付登记结算费和其他必要的手续费。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低申购费率和赎回费率。

5、办理人民币份额的场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

5、申购份额、赎回金额与基金份额净值的计算

(1) 申购份额的计算方式

1) 申购人民币份额的计算方式

场外、场内申购本基金人民币份额均采用金额申购的方式，申购金额包括申购费用和净申购金额。

申购费用适用比例费率的情形下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{人民币份额申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T 日基金份额净值}$$

申购费用适用固定金额的情形下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T 日基金份额净值}$$

场外申购人民币份额的计算按四舍五入方法，留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担；场内申购人民币份额的计算先按四舍五入方法保留到小数点后两位，再按截尾法保留到整数位，小数部分对应的剩余金额由场内销售机构退还投资者。申购费用、

净申购金额的计算按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金资产承担。

例 1: 某投资者投资 100,000 元通过场外申购本基金人民币份额, 对应的申购费率为 1.2%, 假定申购当日人民币份额净值为 1.086 元, 该投资者可得到的基金份额为:

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.2\%) = 98,814.23 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 98,814.23 = 1,185.77 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,814.23 / 1.086 = 90,989.16 \text{ 份}$$

即: 投资者投资 100,000 元通过场外申购本基金人民币份额, 假定申购当日人民币份额净值为 1.086 元, 可得到 90,989.16 份人民币份额。

例 2: 某投资者投资 100,000 元通过场内申购本基金人民币份额, 对应的申购费率为 1.2%, 假定申购当日人民币份额净值为 1.090 元, 该投资者可得到的基金份额为:

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.2\%) = 98,814.23 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 98,814.23 = 1,185.77 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,814.23 / 1.090 = 90,655.26 \text{ 份} = 90,655 \text{ 份}$$

$$\text{退还给投资者的剩余金额} = 0.26 \times 1.090 = 0.28 \text{ 元}$$

即: 投资者投资 100,000 元通过场内申购本基金人民币份额, 假定申购当日人民币份额净值为 1.090 元, 可得到 90,655 份基金份额, 剩余 0.28 元退还投资者。

2) 申购美元份额的计算方式

申购本基金美元份额采用金额申购的方式, 申购金额包括申购费用和净申购金额。

申购费用适用比例费率的情形下:

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{美元份额申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T 日基金份额净值}$$

申购费用适用固定金额的情形下:

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T 日基金份额净值}$$

例：某投资者投资 10,000 美元申购本基金美元份额，对应的申购费率为 1.2%，假定申购当日美元份额净值为 0.183 美元，该投资者可得到的基金份额为：

$$\text{净申购金额} = 10,000 / (1 + 1.2\%) = 9,881.42 \text{ 美元}$$

$$\text{申购费用} = 10,000 - 9,881.42 = 119.58 \text{ 美元}$$

$$\text{申购份额} = 9,881.42 / 0.183 = 53,996.83 \text{ 份}$$

即：投资者投资 10,000 美元申购本基金美元份额，假定申购当日美元份额净值为 0.183 美元，可得到 53,996.83 份美元份额。

(2) 赎回金额的计算方式

本基金赎回均采用份额赎回的方式。赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份额} \times T \text{ 日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回总额} - \text{赎回费用}$$

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者通过场外赎回本基金 10,000 份人民币份额，持有时间为一年三个月，对应的赎回费率为 0.25%，假设赎回当日人民币份额净值是 1.152 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总额} = 10,000 \times 1.152 = 11,520 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 11,520 \times 0.25\% = 28.80 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 11,520 - 28.80 = 11,491.20 \text{ 元}$$

即：投资者通过场外赎回本基金 10,000 份人民币份额，持有期限为一年三个月，假设赎回当日人民币份额净值是 1.152 元，则其可得到的赎回金额为 11,491.20 元。

例：某投资者通过场内赎回本基金 10,000 份人民币份额，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日人民币份额净值是 1.150 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总额} = 10,000 \times 1.150 = 11,500 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 11,500 \times 0.5\% = 57.50 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 11,500 - 57.50 = 11,442.50 \text{ 元}$$

即：投资者通过场内赎回本基金 10,000 份人民币份额，假设赎回当日人民币份额净值是 1.150 元，则其可得到的赎回金额为 11,442.50 元。

(3) 本基金分别计算人民币份额和美元份额的基金份额净值。人民币份额净值的计算精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担；美元份额净值的计算精确到 0.0001 美元，小数点后第五位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。基金份额净值应当在估值日后 2 个工作日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

十五、《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，华宝兴业基金管理有限公司对《华宝兴业标普美国品质消费股票指数证券投资基金(LOF)招募说明书》作如下更新：

- 1、“四、基金的投资”更新了本基金截至 2017 年 6 月 30 日的基金投资组合报告。
- 2、“五、基金的业绩”更新了本基金截至 2017 年 6 月 30 日的基金业绩数据。
- 3、“六、基金管理人”更新了基金管理人的相关信息。
- 4、“十八、基金托管人”更新了基金托管人的相关信息。
- 5、“二十、相关服务机构”更新了本基金代销机构的相关信息。
- 6、“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。

华宝兴业基金管理有限公司

2017 年 10 月 31 日