

# 上证 180 成长交易型开放式指数证券投资 基金招募说明书（更新）摘要

2017 年第 1 号

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

## 重要提示

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

基金管理人保证《上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，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。

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

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，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基金招募说明书编写，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。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人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 2017 年 2 月 4 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 12 月 31 日，财务数据未经审计。

## 一、 基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：华宝兴业基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

法定代表人：郑安国

总经理：HUANG Xiaoyi Helen（黄小慧）

成立日期：2003 年 3 月 7 日

注册资本：1.5 亿元

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、董事长，华宝投资有限公司董事、总经理。现任华宝兴业基金管理有限公司董事长，中国太平洋保险(集团)股份有限公司董事。

HUANG Xiaoyi Helen（黄小慧）女士，董事，硕士。曾任加拿大 TD Securities 公司金融分析师，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有限公司任总经理高级顾问。现任公司常务副总经理。

胡光先生，独立董事，硕士。曾任美国俄亥俄州舒士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、高级管理人员

郑安国先生，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。

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混合型证券投资基金基金经理。现任华宝兴业基金管理有限公司副总经理兼投资总监。

向辉先生，副总经理，硕士。曾在武汉长江金融审计事务所任副所长、在长盛基金管理有限公司市场部任职。2002 年加入华宝兴业基金公司参与公司的筹建工作，先后担任公司清算登记部总经理、营运副总监、营运总监。现任公司副总经理。

刘月华先生，督察长，硕士。曾在冶金工业部、国家冶金工业局、中国证券业协会等单位工作。现任华宝兴业基金管理有限公司督察长。

#### 4、本基金基金经理

胡洁女士，金融学硕士、量化投资部总经理助理。2006年6月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后在交易部、产品开发部工作，担任量化投资部高级数量分析师兼任投资经理助理的职务。2012年10月起任上证180成长交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015年5月21日起任华宝兴业中证医疗指数分级证券投资基金基金经理。2015年6月4日起任华宝兴业中证1000指数分级证券投资基金基金经理。2016年8月起任华宝兴业中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2017年1月起任华宝兴业标普中国A股红利机会指数证券投资基金（LOF）基金经理。

华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金的历任基金经理为余海燕女士，任职时间为2011年8月至2012年10月。

#### 5、投资决策委员会成员

任志强先生，副总经理、投资总监。

刘自强先生，投资副总监、华宝兴业动力组合混合型证券投资基金基金经理、华宝兴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、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，助理投资总监、国内投资部总经理、华宝兴业行业精选混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理、华宝兴业稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

胡戈游先生，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。

### （三）基金管理人内部控制制度

#### 1、风险管理体系

本系列基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规性风险、信誉风险和事件风险（如灾难）。

针对上述各种风险，本公司建立了一套完整的风险管理体系，具体包括以下内容：

（1）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、建立完善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合规控制声明书

（1）本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

（2）本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制。

## 二、 基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：(010) 66594942

中国银行客服电话：95566

### （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### （三）证券投资基金托管情况

截至2016年12月31日，中国银行已托管534只证券投资基金，其中境内基金500只，QDII基金34只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

### （四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获



得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2016年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

#### （五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

### 三、 相关服务机构

#### （一）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）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：021-68751860

传真：027-85481900

客户电话：95579 或 4008-888-999

公司网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

###### （2）大同证券有限责任公司

客户服务电话：4007-121212

公司网址：[www.dtsbc.com.cn](http://www.dtsbc.com.cn)

###### （3）第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼

法定代表人：刘学民

客服电话：95358

官网：[www.firstcapital.com.cn](http://www.firstcapital.com.cn)

联系电话：0755-23838751

联系人：吴军

(4) 东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号东吴证券大厦

联系人：路晓

联系电话：0512-62938521

传真：0512-65588021

客户电话：95330

公司网址：<http://www.dwzq.com.cn>

(5) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 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：021-6215 1789

客户电话：95525、

公司网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(6) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

联系人：黄岚

客户电话：95575 或致电各地营业网点

公司网址：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

(7) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

联系人：罗春蓉、陈曦、康楠

联系电话：010-65051166

传真：010-65051166

客户电话：400-910-1166

(8) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

联系电话：0351-8686889

客户电话：95521

公司网址：www.gtja.com

(9) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16 楼至 26 楼

联系人：李颖

联系电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客户电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

(10) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海淮海中路 98 号

联系人：李楠

联系电话：021-23219061

客户电话：95553、或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址：www.htsec.com

(11) 红塔证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

客户电话：0871-3577930

公司网址：www.hongtazq.com

(12) 华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 楼

联系电话：021-20515583

传真：021-68777822

客户电话：400-820-9898，021-38929908

公司网址：<http://www.cnhbstock.com>

(13) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

联系电话：0591-96326、400-88-96326

客户电话：96326（福建省外请加拨 0591）

公司网址: [www.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn)

(14) 华泰证券股份有限公司

注册地址: 南京市江东中路 228 号

联系人: 庞晓芸

联系电话: 025-83389999

传真: 025-83387337

客户电话: 95597

公司网址: [www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

(15) 平安证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区中心区金田路 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](http://www.stock.pingan.com)

(16) 山西证券股份有限公司

注册地址: 山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址: 山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

联系人: 邓颖赞

联系电话: 0351-8686889

传真: 0351-8686619

客户电话: 400-666-1618、95573

公司网址: [www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

(17) 上海证券有限责任公司

注册地址: 上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

办公地址: 上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

联系人: 邵珍珍

联系电话: 021-53686262

传真: 021-53686100, 021-53686200

客户电话: 021-962518

公司网址: [www.962518.com](http://www.962518.com)

(18) 申万宏源证券有限公司

注册地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

联系人: 黄莹

联系电话: 021-33389888

传真: 021-33388224

客户电话: 95523 或 4008895523

公司网址: [www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

(19) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址: 新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址: 新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

联系人: 黄莹

联系电话: 0991-2307105

传真: 0991-2301927

客户电话: 400-800-0562

公司网址: [www.hysec.com](http://www.hysec.com)

(20) 西南证券股份有限公司

注册地址: 重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址: 重庆市江北区桥北苑 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](http://www.swsc.com.cn)

(21) 兴业证券股份有限公司

注册地址: 福州市湖东路 268 号

联系人: 业务公共邮箱

联系电话: 0591-38281963

客户电话: 95562

公司网址: [www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

(22) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

联系人：邓颜

联系电话：010-66568292

客户电话：95551

公司网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(23) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 39—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 39—45 层

联系人：黄婵君

联系电话：0755- 82960167

客户电话：4008895565、95565

公司网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

(24) 中航证券有限公司

注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

联系人：戴蕾

联系电话：0791- 83811898

客户电话：95535

公司网址：[www.avicsec.com](http://www.avicsec.com)

(25) 中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

联系人：吴阳

联系电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客户电话：95538

公司网址：[www.zts.com.cn](http://www.zts.com.cn)

(26) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 座第 04 层、18-21 层

联系人：张鹏

联系电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

客户电话：95532

公司网址：www.china-invs.cn

(27) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街188号

联系人：许梦园

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

(28) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期北座）

联系人：王东明

联系电话：010-60838888

传真：010-6083 6029

客户电话：95548

公司网址：www.cs.ecitic.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。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：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址：中国上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：曹阳

经办注册会计师：薛竞、曹阳

#### **四、 基金的名称**

本基金名称：上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金

#### **五、 基金的类型**

本基金类型：股票型指数基金

本基金运作方式：交易型、开放式

#### **六、 基金的投资目标**

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

#### **七、 基金的投资范围**

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，指数化投资比例即投资于指数成份股、



备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%，如因标的指数成份股调整、基金份额申购、赎回清单内现金替代、现金差额、基金规模或市场变化等因素导致基金投资比例不符合上述标准的，基金管理人将在 10 个交易日内进行调整。同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## 八、基金的投资策略

### （一）投资策略

#### 1、股票资产指数化投资策略

本基金股票资产投资原则上采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数。通常情况下，本基金根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量，并根据标的指数成份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、权证投资策略

本基金具备投资权证的条件。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

### （二）投资组合管理

本基金采用完全复制法进行指数化投资，按照成份股在上证 180 成长指数中的基准权重构建指

数化投资组合。当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。

## 九、基金的业绩比较基准

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

本基金的标的指数为上证风格指数系列中的上证 180 成长指数（指数代码为 000028）。

上证 180 风格指数是由中证指数公司编制并发布。它以上证 180 指数为样本空间，共包含 4 只指数，包括上证 180 成长指数、上证 180 价值指数、上证 180 相对成长指数和上证 180 相对价值指数。其中，上证 180 成长指数是从上证 180 指数样本股中，挑选最具代表性的 60 只成长股票形成指数。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。

## 十、基金的风险收益特征

本基金为股票型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合基金。

## 十一、基金的投资组合报告

本基金的投资组合报告所载的数据截至 2016 年 12 月 31 日，本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	52,193,495.84	97.76
	其中：股票	52,193,495.84	97.76
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	1,194,934.62	2.24
8	其他资产	838.86	0.00
9	合计	53,389,269.32	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	-	-
C	制造业	11,804,888.75	22.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	338,430.00	0.64
E	建筑业	2,347,014.00	4.43
F	批发和零售业	459,311.50	0.87
G	交通运输、仓储和邮政业	184,756.00	0.35
H	住宿和餐饮业	82,488.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,860,572.50	3.51
J	金融业	30,564,218.29	57.73
K	房地产业	4,136,616.80	7.81
L	租赁和商务服务业	415,200.00	0.78
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	52,193,495.84	98.58

### (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部分的股票投资。

### (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	150,334	5,326,333.62	10.06
2	601166	兴业银行	235,500	3,800,970.00	7.18

3	600016	民生银行	417,500	3,790,900.00	7.16
4	600036	招商银行	182,118	3,205,276.80	6.05
5	600519	贵州茅台	8,952	2,991,310.80	5.65
6	600000	浦发银行	152,690	2,475,104.90	4.67
7	601668	中国建筑	264,900	2,347,014.00	4.43
8	600837	海通证券	142,800	2,249,100.00	4.25
9	601169	北京银行	214,852	2,096,955.52	3.96
10	600887	伊利股份	107,100	1,884,960.00	3.56

(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

本基金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 成长 ETF 基金截至 2016 年 12 月 31 日前十名证券中的海通证券(600837)于 2016 年 11 月 25 日收到中国证监会处罚决定。因公司未按照相关规定对客户的信息进行审查和了解，违反了《证券公司监督管理条例》第 28 条第 1 款规定。对海通证券责令改正，给予警告，没收违法所得约 2,865 万元，并处以约 8,595 万元罚款。

上证 180 成长 ETF 基金截至 2016 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的招商银行(600036)于 2016 年 1 月 9 日收到吉林证监局《关于对招商银行股份有限公司长春分行采取责令改正措施的决定》。由于吉林省分行在从业人员的资格，销售材料，业务流程等多项内容上存在问题，现要求对上述行为进行改正，并于 2016 年 1 月 31 日前，向吉林证监局提交整改情况的书面报告，并等待检查验收。

本基金为交易型开放式指数证券投资基金，采用完全复制法进行指数化投资，按照成份股在上证 180 成长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。

(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	575.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	263.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	838.86

(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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 十二、基金的业绩

本基金业绩数据为截止 2016 年 12 月 31 日的的数据，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
2011/08/04-2011/12/31	-11.80%	1.06%	-19.09%	1.41%	7.29%	-0.35%
2012/01/01-2012/12/31	14.17%	1.24%	12.89%	1.24%	1.28%	0.00%
2013/01/01-2013/12/31	-9.33%	1.53%	-11.57%	1.54%	2.24%	-0.01%
2014/01/01-2014/12/31	56.08%	1.29%	52.16%	1.29%	3.92%	0.00%
2015/01/01-2015/12/31	1.33%	2.45%	1.05%	2.48%	0.28%	-0.03%
2016/01/01-2016/12/31	-5.40%	1.31%	-6.76%	1.33%	1.36%	-0.02%
2011/08/04-2016/12/31	36.60%	1.59%	15.79%	1.62%	20.81%	-0.03%

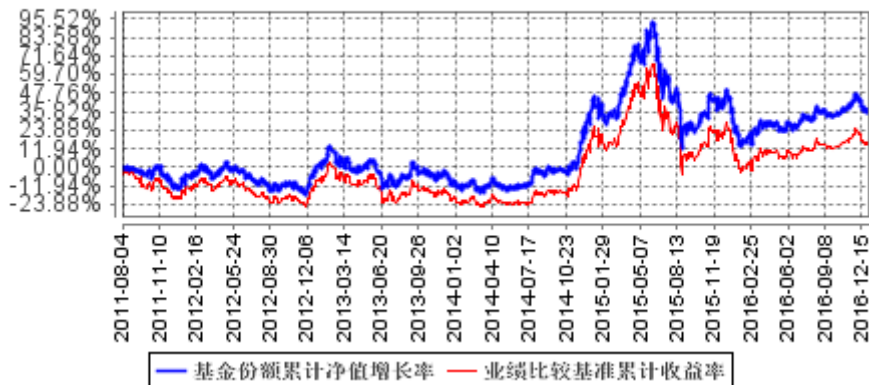
(二) 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

上证 180 成长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

(2011 年 8 月 4 日至 2016 年 12 月 31 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：按照基金合同的约定，自基金成立日期的 6 个月内达到规定的资产组合，截至 2012 年 2 月 4 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

### 十三、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；
- (3) 标的指数许可使用费；
- (4) 因基金的证券交易或结算而产生的费用；
- (5) 基金合同生效以后的信息披露费用；
- (6) 基金份额持有人大会费用；
- (7) 基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- (8) 基金资产的资金汇划费用及开户费用；
- (9) 基金收益分配中发生的费用；
- (10) 基金上市费及年费；
- (11) 按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金资产总值中扣除。

##### 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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 0.5%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.5%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

###### (2) 基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.1%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

### (3) 标的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付标的指数使用费。指数使用费按前一日的基金资产净值的 0.03% 的年费率计提。指数使用费每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

$$H=E \times 0.03\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应付的指数许可使用费，E 为前一日的基金资产净值。

指数使用费的收取下限为每季度人民币伍万元（50,000）。

标的指数供应商根据相应指数许可协议变更上述标的指数使用许可费费率和计费方式，基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前 2 日在指定媒体上刊登公告。

(4) 本章第（一）款第 3 至第 11 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

### 3、不列入基金费用的项目

本章第（一）款约定以外的其他费用，以及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等不列入基金费用。

### 4、费用调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

### 5、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

#### (二) 与基金有关的销售费用

投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过申购或赎回份额 0.5% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、注册登记机构等收取的相关费用。

## 十四、《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《上证 180 成长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”更新了代销机构的相关信息。
- 4、“九、基金份额的申购与赎回”更新了申购、赎回清单的格式。
- 5、“十、基金的投资”更新了截至 2016 年 12 月 31 日的基金投资组合报告及投资限制的相关内容。
- 6、“十一、基金的业绩”更新了截至 2016 年 12 月 31 日的基金业绩数据。
- 7、“二十三、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 3 月 18 日