

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：中国建设银行股份有限公司

### 【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会2016年5月27日证监许可【2016】1152号文注册，进行募集。

基金管理人保证《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、由于投资者连续大量赎回基金份额产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险等等。同时由于本基金是跟踪中证全指证券公司指数的交易型开放式指数基金，投资本基金可能遇到的风险还包括：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、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、退市风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、申赎清单差错风险、二级市场流动性风险、第三方机构服务的风险、管理风险与操作风险、技术风险、不可抗力等等。本基金被动跟踪标的指数“中证全指证券公司指数”，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，因此，本基金的业绩表现与中证全指证券公司指数的表现密切相关。同时，本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，属于高风险高收益的开放式基金。

在目前结算规则下，投资者申购的基金份额当日可卖出，当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回；即T日申购的基金份额当日可卖出，T日申购当日未卖出的基金份额，T+1日不得卖出和赎回，T+1日交收成功后T+2日可卖出和赎回。因此为投资者办理申购业务的代理券商若发生交收违约，将导致投资者不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额，投资者的利益可能受到影响。

在目前的业务规则下，投资者投资本基金时需具有上海证券交易所A股账户或基金账户。其中，上海证券交易所基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易，如投资者需要使用中证全指证券公司指数成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金的申购、赎回，则应开立上海证券交易所A股账户；如投资者需要使用中证全指证券公司指数成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购，则还应开立深圳证券交易所A股账户。

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。

投资有风险，投资者认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书。

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。

本招募说明书所载内容截止日为 2017 年 3 月 2 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、《基金合同》生效日期

本基金自 2016 年 7 月 11 日到 2016 年 8 月 1 日向个人投资者和机构投资者同时发售，《基金合同》于 2016 年 8 月 5 日生效。

## 二、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：华宝兴业基金管理有限公司

住所：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，现任华宝兴业基金管理有限公司营运副总监。

## 3、总经理及其他高级管理人员

郑安国先生，董事长，简历同上。

HUANG Xiaoyi Helen (黄小蕙) 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

丰晨成先生。2009 年加入华宝兴业基金管理有限公司, 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 月任华宝兴业上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2016 年 8 月兼任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基金经理。

#### 5、权益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。

#### 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、基金管理人不得从事下列行为：

- （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第三人牟取利益；
- （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，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：王洪章

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)。

2015 年末，本集团资产总额 18.35 万亿元，较上年增长 9.59%；客户贷款和垫款总额 10.49 万亿元，增长 10.67%；客户存款总额 13.67 万亿元，增长 5.96%。净利润 2,289 亿元，增长 0.28%；营业收入 6,052 亿元，增长 6.09%，其中，利息净收入增长 4.65%，手续费及佣金净收入增长 4.62%。平均资产回报率 1.30%，加权平均净资产收益率 17.27%，成本收入比 26.98%，资本充足率 15.39%，主要财务指标领先同业。

物理与电子渠道协同发展。营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点数量达 1.45 万个，综合营销团队 2.15 万个，综合柜员占比达到 88%。启动深圳等 8 家分行物理渠道全面转型创新试点，智慧网点、旗舰型、综合型和轻型网点建设有序推进。电子银行主渠道作用进一步凸显，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达 95.58%，较上年提升 7.55 个百分点；同时推广账号支付、手机支付、跨行付、龙卡云支付、快捷付等五种在线支付方式，成功实现绝大多数主要快捷支付业务的全行集中处理。

转型业务快速增长。信用卡累计发卡量 8,074 万张，消费交易额 2.22 万亿元，多项核心指标继续保持同业领先。金融资产 1,000 万以上的私人银行客户数量增长 23.08%，客户金融资产总量增长 32.94%。非金融企业债务融资工具累计承销 5,316 亿元，承销额市场领先。资产托管业务规模 7.17 万亿元，增长 67.36%；托管证券投资基金数量和新增只数均为

市场第一。人民币国际清算网络建设再获突破，继伦敦之后，再获任瑞士、智利人民币清算行资格；上海自贸区、新疆霍尔果斯特殊经济区主要业务指标居同业首位。

2015年，本集团先后获得国内外各类荣誉总计122项，并独家荣获美国《环球金融》杂志“中国最佳银行”、香港《财资》杂志“中国最佳银行”及香港《企业财资》杂志“中国最佳银行”等大奖。本集团在英国《银行家》杂志2015年“世界银行品牌1000强”中，以一级资本总额位列全球第二；在美国《福布斯》杂志2015年度全球企业2000强中位列第二。

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

赵观甫，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力争，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，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。

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。

## （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、QFII、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2016年一季度末，中国建设银行已托管584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。中国建设银行自 2009 年至今连续六年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

## 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。资产托管业务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

### （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“托管业务综合系统——基金监督子系统”，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，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。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. 每工作日按时通过基金监督子系统，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，并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、网下现金发售和网下股票发售直销机构

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

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

直销柜台传真: 021-50499663、50988055

联系人: 章希

网址: [www.fsfund.com](http://www.fsfund.com)

###### 2、网下现金发售和网下股票发售代理机构

###### (1) 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](http://www.essence.com.cn)

###### (2) 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](http://www.cgws.com)

###### (3) 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](http://www.95579.com)

(4) 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](http://www.tebon.com.cn)

(5) 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](http://www.nesc.cn)

(6) 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](http://www.dfzq.com.cn)

(7) 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](http://www.longone.com.cn)

(8) 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>

（9）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](http://www.foundersc.com)

（10）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](http://www.ebscn.com)

（11）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：广东省广州天河北路大都会广场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](http://www.gf.com.cn)

（12）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](http://www.gtja.com)

（13）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](http://www.guosen.com.cn)

（14）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](http://www.htsec.com)

（15）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>

（16）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](http://www.htsc.com.cn)

（17）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>

（18）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)

(19) 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)

(20) 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：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](http://www.hysec.com)

(21) 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](http://www.cindasc.com)

(22) 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](http://www.xyzq.com.cn)

(23) 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](http://www.chinastock.com.cn)

(24) 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](http://www.newone.com.cn)

(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](http://www.csc108.com)

(27) 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](http://www.cs.ecitic.com)

(28) 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

### 3、网上现金发售代理机构

投资人可直接通过具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司办理网上现金认购业务。详见基金份额发售公告。

本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的上海证券交易所会员可通过上海证券交易所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。

基金管理人可以根据情况增加其他发售代理机构，并另行公告。

#### （二）登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所、办公地址：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

联系电话：010-58598839

传真：010-58598907

#### （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

注册地址：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

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陆奇

经办律师：黎明、陆奇

#### （四）审计基金财产的会计师事务所

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：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

## 五、基金简介

基金名称：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

基金类型：契约型开放式

## 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

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。

为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股（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、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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的相关规定）。

如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。

在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

### （三）投资策略

本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

#### 1、组合复制策略

本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

#### 2、替代性策略

对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。

#### 3、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。

#### 4、股指期货、权证等金融衍生工具投资策略

在法律法规许可的前提下，本基金可基于谨慎原则运用权证、股指期货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，降低跟踪误差，以更好地实现本基金的投资目标。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

本基金在权证投资中将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。

未来，随着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，并在招募说明书更新中公告。

#### （四）投资组合管理

本基金的指数化投资采用组合复制法，按照成份股在中证全指证券公司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）投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%；

（2）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%；

（3）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%；

（4）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%；

（5）当本基金参与股指期货交易时，需依据下列标准建构组合：

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%；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100%，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；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%；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%；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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；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；

（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) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(13) 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。

因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制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。

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基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，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照调整后的规定执行。

## 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其他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的原则，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、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

### (六) 标的指数

中证全指证券公司指数

### (七) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数，即中证全指证券公司指数。

如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布，或者上述标的指数由其他指数代替，或由于指数编制方法等重大变更导致上述指数不宜继续作为标的指数，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基金份额持有人合法权益的原则，通过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。若标的指数、业绩比较基准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，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数和业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告。

#### （八）风险收益特征

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高风险高收益的开放式基金。

本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用组合复制策略，跟踪中证全指证券公司指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

#### （九）基金的融资融券及转融通业务

本基金可以根据届时有效的有效法律法规和政策的规定进行融资融券及转融通业务。

#### （十）基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至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	149,516,725.04	98.16
	其中：股票	149,516,725.04	98.16
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	2,084,984.44	1.37
8	其他资产	721,532.09	0.47
9	合计	152,323,241.57	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	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	149,341,554.66	98.87
K	房地产业	-	-
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	149,341,554.66	98.87

2) 报告期末积极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	采掘业	-	-
C	制造业	97,353.53	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	15,592.23	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	7,564.62	0.01
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	54,480.00	0.04
K	房地产业	-	-
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	174,990.38	0.12

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	600837	海通证券	1,196,700	18,848,025.00	12.48
2	600030	中信证券	1,168,500	18,766,110.00	12.42
3	601211	国泰君安	665,938	12,379,787.42	8.20
4	601688	华泰证券	488,483	8,724,306.38	5.78
5	000776	广发证券	443,300	7,474,038.00	4.95
6	600958	东方证券	451,500	7,011,795.00	4.64
7	002736	国信证券	369,900	5,751,945.00	3.81
8	600999	招商证券	334,492	5,462,254.36	3.62
9	601377	兴业证券	702,400	5,373,360.00	3.56
10	601099	太平洋	1,026,400	5,285,960.00	3.50

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

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	601375	中原证券	13,620	54,480.00	0.04
2	603218	日月股份	1,196	49,813.40	0.03
3	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.01
4	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.01
5	603035	常熟汽饰	992	10,356.48	0.01

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序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。

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。

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) 券商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。因公司未按照有关规定对客户的信息进行审查和了解，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。

券商ETF基金截至2016年12月31日前十名证券中的中信证券（600030）于2016年3月16日收到中国证券监督管理委员会福建监管局《关于对中信证券股份有限公司泉州宝洲路证券营业部采取出具警示函措施的决定》，因公司营业部存在员工违规为客户融资提供便利的问题，决定对营业部采取出具警示函的监督管理措施。

中信证券（600030）于2016年8月23日收到全国中小企业股份转让系统《关于对中信证券股份有限公司采取出具责令改正自律监管措施的决定》。在投资者适当性管理过程中，未依据委托代理协议签署日前一交易日日终的投资者名下证券类资产市值判断适当性，而是错误根据投资者临柜办理业务权限开通手续时点的实时资产市值，为506户不符合要求的投资者账户开通全国股转系统合格投资者权限，违反了《全国中小企业股份转让系统投资者适当性管理细则（试行）》第五条关于自然人投资者证券类资产市值计算时点要求的规定。决

定对公司采取责令改正的自律监管措施。

券商 ETF 基金截至 2016 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的国泰君安（601211）于 2016 年 1 月 29 日收到全国中小企业股份转让系统公开谴责。因国泰君安以明显低于最近成交价的价格进行卖出申报，造成做市股票尾盘价格大幅波动，严重影响了多只股票的正常转让价格，扰乱了正常市场秩序，决定给予国泰君安证券股份有限公司公开谴责。

国泰君安（601211）于 2016 年 2 月 16 日收到中国证券监督管理委员会上海监管局《中国证券监督管理委员会上海监管局行政监管措施事先告知书》（沪证监机构字[2016]22 号）。因其场外市场部做市业务部门的绩效考核体系、内部管理与控制方面等存在重大缺陷，导致 2015 年 12 月 31 日做市股票发生一系列报价异常事件，造成恶劣的市场影响。决定限制其新增做市业务三个月，并责令其在规定时间内，每 3 个月对做市业务部门开展一次内部合规检查，并在每次检查后 10 个工作日内，向上海监管局书面报送合规检查报告。并于 2016 年 2 月 26 日，收到上海监管局《关于对国泰君安证券股份有限公司采取限制新增做市业务等监管措施的决定》（沪证监决[2016]15 号）。

国泰君安（601211）于 2016 年 6 月 29 日收到中国证监会北京监管局警告。因其作为受托管理人，未能及时发现和制止违规的转借行为，违反了《公司债券发行与交易管理办法》第七条和第五十条第二款的规定，决定对公司采取出具警示函的行政监管措施。

国泰君安（601211）于 2016 年 7 月 26 日收到中国证券监督管理委员会上海监管局整改通知。因其作为国泰君安新利 6 号集合资产管理计划的资产管理人，投资决策和交易执行环节控制存在不足，发生相关异常交易。公司未能切实履行勤勉尽责的管理人义务，未能采取有效措施防范利益冲突，责令公司增加内部合规检查次数，并及时提交合规检查报告。

国泰君安（601211）于 2016 年 8 月 26 日收到中国证券监督管理委员会整改通知。因其内核机构履职的独立性存在缺陷，未在规定时间内完成并报送《持续督导现场检查工作报告》。并且在推荐企业进入全国中小企业股份转让系统挂牌过程中，对企业关键业务流程、购销情况的核查不充分。拟责令公司改正、增加内部合规检查次数并提交合规检查报告。

国泰君安（601211）于 2016 年 8 月 26 日收到中国证监会警告。因国泰君安在保荐金徽酒首发项目过程中，向中国证监会提交的会后事项承诺函中未如实说明发行人 2015 年利润分配情况，对发行人实施分红事项，未主动向我会履行告知义务，对国泰君安采取了出具警示函的行政监管措施。

券商 ETF 基金截至 2016 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的华泰证券（601688）于 2016 年 8 月 23 日收到全国股转公司警示函。因公司在投资者适当性管理过程中存在违规事实，决定对公司采取出具警示函、责令改正的自律监管措施。

华泰证券（601688）于 2016 年 11 月 25 日收到中国证监会处罚决定。因公司未按照有关规定对客户的信息进行审查和了解，对华泰证券责令改正，给予警告，没收违法所得约 1,823 万元，并处以约 5,470 万元罚款。

券商 ETF 基金截至 2016 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的广发证券（000776）于 2016 年 11 月 24 日收到中国证券监督管理委员会辽宁监管局整改通知。因公司营口学府路证券营业部在代销宝盈新动力 3、7、15 号产品过程中，未能全面、公正、准确地介绍金融产品有关信息，充分说明金融产品的主要风险特征，未能保证金融产品营销人员充分了解所负责推介金融产品的信息，营业部在产品销售过程中的风险揭示不到位，对广发证券股份有限公司营口学府路证券营业部采取责令改正的措施。

广发证券（000776）于 2016 年 11 月 24 日收到中国证监会处罚决定。因公司在未采集上述客户身份识别信息的情况下，未实施有效的了解客户身份的回访、检查等程序。对广发证券责令改正，给予警告，没收违法所得 6,805,135.75 元，并处以 20,415,407.25 元罚款。

券商 ETF 基金截至 2016 年 12 月 31 日持仓前十名证券中的国信证券（002736）于 2016 年 1 月 9 日收到江苏证监局责令改正措施的决定。因国信证券无锡梁溪路证券营业部个别客户在付款购买金融产品前未签署风险揭示书，个别客户在购买金融产品时，其风险承受能力与产品风险等级不匹配，营业部未按规定与客户签署《金融产品或金融服务不适当警示及客户投资确认书》的问题，责令营业部予以改正。

国信证券（002736）于 2016 年 3 月 29 日收到江苏证监局警告。因营业部在开展代销金融产品业务中，合同签署时没有向个别客户出示相关备查文件，对营业部采取出具警示函的监管措施。

国信证券（002736）于 2016 年 3 月 30 日收到全国中小企业股份转让系统警告。主办券商未严格执行全国股转系统投资者适当性管理的各项要求，未正确履行合格投资者报送义务，构成违规。

国信证券（002736）于 2016 年 4 月 27 日收到中国证券监督管理委员会北京监管局整改通知。因国信证券股份有限公司北京北苑路证券营业部在未申请换发经营证券业务许可证的情况下迁址并更名。但未及时申请变更。决定责令公司增加内部合规检查次数，在 2016 年 5 月 1 日至 2017 年 4 月 30 日期间，每 3 个月对分公司管理的营业部同城迁址、名称变更以及换发证照等相关业务增加一次内部合规检查。

国信证券（002736）于 2016 年 5 月 23 日收到中国证券监督管理委员会天津监管局整改通知。因营业部个别客户在付款购买金融产品前未签署风险揭示书，个别客户在购买金融产品时，其风险承受能力与产品风险等级不匹配，营业部未按规定与客户签署《金融产品适当性评估告知及客户投资确认书》，责令营业部予以改正。

国信证券（002736）于 2016 年 6 月 14 日收到湖北证监局整改通知。因营业部存在未妥善保存员工通过 95536 客服坐席呼出电话的通话录音，且在经营管理过程中长时间未发现；营业部员工信息公示不规范；负责人年度考核不全面；客户投资者适当性评估资料不完整等问题。责令营业部在 2016 年 6 月 20 日至 2017 年 6 月 19 日期间，每三个月开展一次内部合规检查，并在每次检查后十个工作日内，报送合规检查报告。

国信证券（002736）于2016年11月8日收到深圳证监局整改通知。因天津、江苏、青岛等地营业部在开展代销金融产品业务中，个别客户在付款购买金融产品前未签署风险揭示书，个别客户在购买金融产品时，其风险承受能力与产品风险等级不匹配，营业部未按规定与客户签署《金融产品适当性评估告知及客户投资确认书》，合同签署时没有向个别客户出示相关备查文件等问题。对公司采取责令改正的监管措施。

券商ETF基金截至2016年12月31日持仓前十名证券中的招商证券（600999）于2016年1月9日收到中国证监会广西监管局整改通知。因招商证券股份有限公司南宁民族大道证券营业部存在未实施回访、审查等有效了解客户身份的程序，且在发现客户将本人的信用证券账户提供给他人使用后，未按照证券登记结算机构的业务规则处理，也未及时向证券登记结算机构和证券交易所报告的情况。责令营业部对上述问题予以改正。

券商ETF基金截至2016年12月31日持仓前十名证券中的兴业证券（601377）于2016年2月20日收到中国证券监督管理委员会福建监管局整改通知。因公司融资融券强制平仓操作出现差错，导致客户信用账户股票的实际强制平仓数量远超过应当平仓数量；7月8日，公司未经客户同意直接在客户信用账户进行买回操作。责令公司在2016年3月1日至2017年2月28日期间，每3个月对融资融券业务进行一次内部合规检查，并在每次检查后10个工作日内，报送合规检查报告。

兴业证券（601377）于2016年6月13日收到中国证券监督管理委员会立案调查。因公司涉嫌未按规定履行法定职责，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对公司立案调查。于2016年7月9日收到中国证监会处罚决定，对公司给予警告，没收保荐业务收入1,200万元，并处以2,400万元罚款；没收承销股票违法所得2,078万元，并处以60万元罚款。

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，按照成份股在中证全指证券公司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两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	166,091.00
2	应收证券清算款	554,694.00
3	应收股利	-
4	应收利息	747.09
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	721,532.09

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

本基金本报告期末指数投资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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601375	中原证券	54,480.00	0.04	新股锁定
2	002838	道恩股份	10,405.68	0.01	新股锁定
3	603035	常熟汽饰	10,356.48	0.01	新股锁定

## 七、基金的业绩

本基金业绩数据为截止 2016 年 12 月 31 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
2016/08/30-2016/12/31	-3.00%	1.03%	-4.15%	1.11%	1.15%	-0.08%

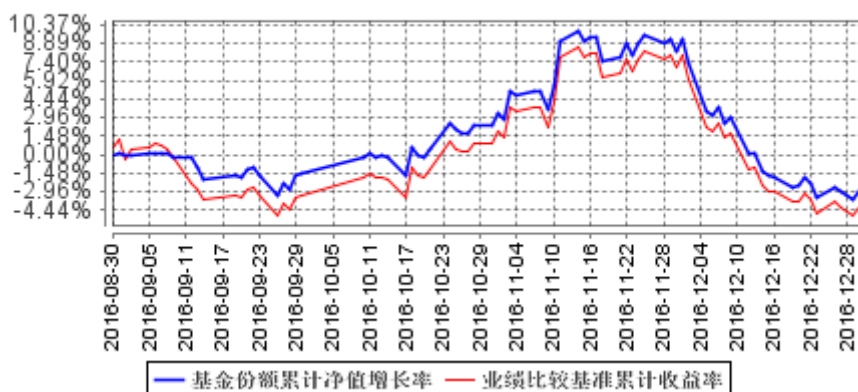
(二) 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华宝兴业中证军工指数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

(2016 年 8 月 30 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配置，截至2017年3月2日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

### 八、基金份额的申购和赎回

#### (一) 申购和赎回场所

对于申购赎回的投资者，应当在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。基金管理人在开始申购、赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单，并可依据实际情况变更申购赎回代理券商，予以公告。基金管理人在确定、变更申购赎回代理券商名单时，均应在公告之前报请上海证券交易所认可。

#### (二) 申购和赎回的开放日及时间

##### 1、开放日及开放时间

投资者在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

##### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

本基金可在基金上市交易之前开始办理申购、赎回，但在基金申请上市期间，可暂停办

理申购、赎回。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

### （三）申购和赎回的原则

- 1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购、赎回均以份额申请；
- 2、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；
- 3、申购、赎回申请提交后不得撤销；
- 4、申购、赎回应遵守《业务规则》及其他相关规定。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### （四）申购和赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

投资者必须根据申购赎回代理券商或基金管理人规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者交付申购对价，申购成立；登记机构确认申请时，申购生效。投资者在提交赎回申请时有足够的赎回对价，则赎回申请成立，登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者在提交申购申请时须按申购赎回清单的规定备足申购对价，投资者在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额和现金，否则所提交的申购、赎回申请不成立。

#### 2、申购和赎回申请的确认

基金投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请不成立。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请不成立。投资者可在申请当日通过其办理申购、赎回的销售机构或以其提供的其他方式查询确认情况。

投资者申购的基金份额当日可卖出，当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回；即在目前结算规则下，T日申购的基金份额当日可卖出，T日申购当日未卖出的基金份额，T+1日不得卖出和赎回，T+1日交收成功后T+2日可卖出和赎回。投资者赎回获得的股票当日可卖出。

申购赎回代理券商对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表申购赎回代理券商确实接收到该申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购、赎回申请的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利。

#### 3、申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购赎回过程中涉及的基金份额、组合证券、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》和参与各方相



关协议的有关规定，对于本基金的申购业务采用净额结算、代收代付和逐笔全额结算相结合的方式，其中上海证券交易所上市的成份股的现金替代、申购并当日卖出的基金份额及对应的深圳证券交易所上市的成份股的现金替代采用净额结算，申购当日未卖出的基金份额及对应的深圳证券交易所上市的成份股的现金替代采用逐笔全额结算。对于本基金的赎回业务采用净额结算和代收代付相结合的方式，其中上海证券交易所上市的成份股的现金替代采用净额结算，深圳证券交易所上市的成份股的现金替代采用代收代付。本基金上述申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付。

投资者T日申购成功后，登记机构在T日收市后办理上海证券交易所上市的成份股交收与申购当日卖出基金份额的交收登记以及现金替代的清算；在T+1日办理现金替代的交收与申购当日未卖出基金份额的交收登记以及现金差额的清算；在T+2日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。现金替代交收失败的，该笔申购当日未卖出基金份额交收失败。基金管理人不迟于T+3日办理申购的深圳证券交易所上市的成份股现金替代退补款的交收。

投资者T日赎回成功后，登记机构在T日收市后办理上海证券交易所上市的成份股交收与基金份额的注销以及现金替代的清算；在T+1日办理上海证券交易所上市的成份股现金替代的交收以及现金差额的清算；在T+2日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。基金管理人不迟于T+3日办理赎回的深圳证券交易所上市的成份股现金替代的交付。

如果登记机构和基金管理人在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》和参与各方相关协议的有关规定进行处理。

登记机构和基金管理人可在法律法规允许的范围内，对申购与赎回的程序进行调整，并最迟于开始实施前3个工作日在指定媒介公告。

投资者应按照本基金合同的约定和申购赎回代理券商的规定按时足额支付应付的现金差额和现金替代补款。因投资者原因导致现金差额或现金替代补款未能按时足额交收的，基金管理人有权为基金的利益向该投资者追偿，并要求其承担由此导致的其他基金份额持有人或基金资产的损失。

#### （五）申购和赎回的数额限制

投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

基金管理人可以规定本基金当日申购份额及当日赎回份额上限，具体规定详见更新的招募说明书或相关公告。

本基金最小申购赎回单位为30万份，基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整申购与赎回的数额限制，基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》

的有关规定指定媒介公告。

#### （六）申购、赎回的对价、费用

1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1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。

2、申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资者赎回基金份额时，基金管理人应交付给投资者的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

3、申购赎回清单由基金管理人编制。T日的申购赎回清单在当日证券交易所开市前公告。

4、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0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

基金管理人可以在不违反相关法律法规的情况下对基金份额净值、申购赎回清单计算和公告时间进行调整并提前公告。

#### （七）申购赎回清单的内容与格式

##### 1、申购赎回清单的内容

T日申购赎回清单公告内容包括最小申购、赎回单位所对应的组合证券内各成份证券数据、现金替代、T日预估现金部分、T-1日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。

##### 2、组合证券相关内容

组合证券是指本基金标的指数所包含的全部或部分证券。申购赎回清单将公告最小申购、赎回单位所对应的各成份证券名称、证券代码及数量。

##### 3、现金替代相关内容

现金替代是指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。

1) 现金替代分为4种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）、必须现金替代（标志为“必须”）和退补现金替代（标志为“退补”）。

禁止现金替代适用于上海证券交易所上市的成份股，是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

可以现金替代适用于上海证券交易所上市的成份股，是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

必须现金替代适用于所有成份股，是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用固定现金作为替代。

退补现金替代适用于深圳证券交易所上市的成份股，是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。

## 2) 可以现金替代

①适用情形：可以现金替代的证券一般是由于停牌等原因导致投资者无法在申购时买入的证券。目前仅适用于标的指数中的上海证券交易所股票。

②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

替代金额=替代证券数量×该证券参考价格×（1+现金替代溢价比例）

其中，该证券参考价格目前为该证券前一交易日除权除息后的收盘价。

如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。

收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人需在证券恢复交易后买入，而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的最新价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

### ③替代金额的处理程序

T日，基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。

在T日后被替代的成份证券有正常交易的2个交易日（简称为T+2日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。

T+2日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照T+2日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

特例情况：若自T日起，上海证券交易所正常交易日已达到20日而该证券正常交易日低于2日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

若现金替代日（T日）后至T+2日（若在特例情况下，则为T日起第20个交易日）期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则进行相应调整。

T+2日后第1个工作日（若在特例情况下，则为T日起第21个交易日），基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后3个工作日内完成。

④替代限制：为有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，基金管理人可规定投资者使用

可以现金替代的比例合计不得超过申购基金份额资产净值的一定比例。现金替代比例的计算公式为：

$$x = \frac{\sum_{i=1}^n \text{第}i\text{只替代证券的数量} \times \text{该证券参考价格}}{\text{申购基金份额} \times \text{参考基金份额净值}} \times 100\%$$

该证券参考价格目前为该证券前一交易日除权除息后的收盘价。如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。

参考基金份额净值为本基金前一交易日除权除息后的收盘价。如果上海证券交易所参考基金份额净值计算方式发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考基金份额净值为准。

### 3) 必须现金替代

①适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整，即将被剔除的成份证券以及处于停牌的股票；或因法律法规限制投资的成份证券；或基金管理人出于保护持有人利益等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。。

②替代金额：对于必须现金替代的证券，基金管理人将在申购赎回清单中公告替代的一定数量的现金，即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以其调整后T日开盘参考价。

### 4) 退补现金替代

①适用情形：退补现金替代的证券目前仅适用于标的指数中深圳证券交易所股票。

②替代金额：对于退补现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

申购的替代金额=替代证券数量×该证券调整后T日开盘参考价×(1+现金替代溢价比例)；

赎回的替代金额=替代证券数量×该证券调整后T日开盘参考价×(1-现金替代溢价比例)。

### ③替代金额的处理程序

对退补现金替代而言，申购时收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人将买入该证券，实际买入价格加上相关交易费用后与该证券调整后T日开盘参考价可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

对退补现金替代而言，赎回时扣除现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人将卖出该证券，实际卖出价格扣除相关交易费用后与该证券调整后T日开盘参考价可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此支付替代金额。如果预先支付的金额低于基金卖出该部分证券的实际收入，则基金管理人将退还少支付的差额；如果预先支付的金额高于基金卖出该部分证券的实际收入，则基

金管理人将向投资者收取多支付的差额。

其中，调整后T日开盘参考价主要根据中证指数公司提供的标的指数成份证券的调整后开盘参考价确定。

基金管理人将自T日起在收到申购交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次买入申购被替代的部分证券，在收到赎回交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次卖出赎回被替代的部分证券。T日未完成的交易，基金管理人在T日后被替代的成份证券有正常交易的2个交易日（简称为T+2日）内完成上述交易。

时间优先的原则为：申购赎回方向相同的，先确认成交者优先于后确认成交者。先后顺序按照上海证券交易所确认申购赎回的时间确定。

实时申报的原则为：基金管理人在深圳证券交易所连续竞价期间，根据收到的上海证券交易所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向深圳证券交易所申报被替代证券的交易指令。

T日基金管理人按照“时间优先”的原则依次与申购投资者确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，即按照申购时间顺序，以替代金额与被替代证券的依次实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项；按照“时间优先”的原则依次与赎回投资者确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，即按照赎回时间顺序，以替代金额与被替代证券的依次实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

对于T日因停牌或流动性不足等原因未购入和未卖出的被替代的部分证券，T日后基金管理人可以继续与被替代证券的买入和卖出，按照前述原则确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

T+2日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照T+2日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项。

T+2日日终，若已卖出全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项；若未能卖出全部被替代的证券，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照T+2日收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

特例情况：若自T日起，深圳证券交易所正常交易日已达到20日而该证券正常交易日低于2日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购

投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

若现金替代日（T日）后至T+2日期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则进行相应调整。

T+2日后第1个工作日，基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后3个工作日内完成。

#### 4、预估现金部分相关内容

预估现金部分是指为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理券商预先冻结申请申购、赎回的投资者的相应资金，由基金管理人计算的现金数额。

T日申购赎回清单中公告T日预估现金部分。其计算公式为：

T日预估现金部分=T-1日最小申购、赎回单位的基金资产净值－（申购赎回清单中必须现金替代的固定替代金额+申购赎回清单中退补现金替代成份证券的数量与该证券调整后T日开盘参考价相乘之和+申购赎回清单中可以现金替代成份证券的数量与该证券调整后T日开盘参考价相乘之和+申购赎回清单中禁止现金替代成份证券的数量与该证券调整后T日开盘参考价相乘之和）

其中，该证券调整后T日开盘参考价主要根据中证指数公司提供的标的指数成份证券的调整后开盘参考价确定。另外，若T日为基金分红除息日，则计算公式中的“T-1日最小申购、赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。预估现金部分的数值可能为正、为负或为零。

#### 5、现金差额相关内容

T日现金差额在T+1日的申购赎回清单中公告，其计算公式为：

T日现金差额=T日最小申购、赎回单位的基金资产净值－（申购赎回清单中必须现金替代的固定替代金额+申购赎回清单中退补现金替代成份证券的数量与T日收盘价相乘之和+申购赎回清单中可以现金替代成份证券的数量与T日收盘价相乘之和+申购赎回清单中禁止现金替代成份证券的数量与T日收盘价相乘之和）

T日投资者申购、赎回基金份额时，需按T+1日公告的T日现金差额进行资金的清算交收。

现金差额的数值可能为正、为负或为零。在投资者申购时，如现金差额为正数，则投资者应根据其申购的基金份额支付相应的现金，如现金差额为负数，则投资者将根据其申购的基金份额获得相应的现金；在投资者赎回时，如现金差额为正数，则投资者将根据其赎回的基金份额获得相应的现金，如现金差额为负数，则投资者应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。

#### 6、申购赎回清单的格式

申购赎回清单的格式举例如下

## 基本信息

最新公告日期	2017/3/02
基金名称	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
基金管理公司名称	华宝兴业基金管理有限公司
一级市场基金代码	512001

## 2017/3/1 信息内容

现金差额（单位:元）	520.31
最小申购、赎回单位资产净值（单位:元）	297434.31
基金份额净值（单位:元）	0.9914

## 2017/3/2 日信息内容

当日累计申购上限	80000000
当日累计赎回上限	无
预估现金部分（单位:元）	520.31
现金替代比例上限	50%
是否需要公布 IOPV	是
最小申购、赎回单位（单位:份）	300000
申购、赎回的允许情况	允许申购和赎回

## 成份股信息内容

股票代码	股票简称	股票数量	替代标志	溢价比例	替代金额 (单位:元)
000166	申万宏源	1700	深市退补	10.0%	10880
000686	东北证券	400	深市退补	10.0%	4952
000712	锦龙股份	100	深市退补	10.0%	2157
000728	国元证券	300	深市退补	10.0%	6024
000750	国海证券	900	深市退补	10.0%	6093
000776	广发证券	900	深市退补	10.0%	15912
000783	长江证券	1000	深市退补	10.0%	10340
002500	山西证券	300	深市退补	10.0%	3423
002673	西部证券	400	深市退补	10.0%	7856
002736	国信证券	700	深市退补	10.0%	10668
002797	第一创业	100	深市退补	10.0%	3010
600030	中信证券	2300	允许	10.0%	
600061	国投安信	300	允许	10.0%	
600109	国金证券	600	允许	10.0%	
600369	西南证券	800	允许	10.0%	

600837	海通证券	2400	允许	10.0%	
600958	东方证券	900	允许	10.0%	
600999	招商证券	700	允许	10.0%	
601099	太平洋	2000	允许	10.0%	
601198	东兴证券	300	允许	10.0%	
601211	国泰君安	1300	允许	10.0%	
601377	兴业证券	1400	允许	10.0%	
601555	东吴证券	600	允许	10.0%	
601688	华泰证券	900	允许	10.0%	
601788	光大证券	600	允许	10.0%	
601901	方正证券	1200	必须		10176

#### (八) 拒绝或暂停申购的情形及处理方法

在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停投资者的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金管理人无法受理或办理投资者的申购申请；
- 2、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或无法进行证券交易；
- 3、发生基金合同规定的暂停基金财产估值情况，基金管理人可暂停接受投资者的申购申请；
- 4、基金管理人开市前因异常情况无法公布申购赎回清单、基金份额净值或者 IOPV 计算错误、申购赎回清单编制错误；
- 5、相关证券交易所、申购赎回代理券商、登记机构等因异常情况无法办理申购，或者指数编制单位、相关证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等；
- 6、基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；
- 7、在发生基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时；
- 8、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形；
- 9、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行；
- 10、法律法规、中国证监会或上海证券交易所规定的其他情形。

发生除上述第6项以外的暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### (九) 暂停赎回或延缓支付赎回对价的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回对价：



- 1、因不可抗力导致基金管理人无法受理或办理基金份额持有人的赎回申请；
- 2、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或无法进行证券交易；
- 3、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- 4、在发生基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时；
- 5、基金管理人开市前因异常情况无法公布申购赎回清单、基金份额净值或者 IOPV 计算错误、申购赎回清单编制错误；
- 6、相关证券交易所、申购赎回代理券商、登记机构等因异常情况无法办理赎回，或者指数编制单位、相关证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等；
- 7、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请。
- 8、法律法规、中国证监会或上海证券交易所规定的其他情形。

发生上述情形且基金管理人决定暂停赎回时，基金管理人应报中国证监会备案。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

#### （十）基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的证券交易所以外的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

#### （十一）基金的转托管、非交易过户、冻结、解冻等其他业务

基金的登记机构可依据其业务规则，受理基金的转托管、非交易过户、冻结与解冻等业务，并收取一定的手续费用。

#### （十二）其他

1、基金管理人可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，根据市场情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整，应在新的申购赎回安排实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上予以公告。

2、在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人在条件允许时可开放集合申购即允许多个投资者集合其持有的组合证券共同构成最小申购赎回单位或其整数倍进行申购。基金管理人有权制定集合申购业务的相关规则。

3、在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可调整基金申购赎回方式或申购赎回对价组成，并提前公告。

4、基金管理人指定的代理机构可依据法律法规和基金合同的规定开展其他服务，双方

需签订书面委托代理协议，并报中国证监会备案。

5、在不违反法律法规及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致后，可为本基金增设新的份额类别。

6、对于符合《特定机构投资者参与交易型开放式指数基金申购赎回业务指引》要求的特定机构投资者，基金管理人可在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，安排专门的申购方式，并于新的申购方式开始执行前另行公告。

7、在条件允许的情况下，基金管理人未来可开通场外份额。在条件允许时，基金管理人也可在目前的申赎方式外，采取其他合理的申赎方式（例如以全现金替代方式申赎），并于新的申赎方式开始执行前的至少三个工作日予以公告。基金管理人有权制定相关业务规则。

在不违反法律法规的规定及基金合同的约定、且对基金份额持有人无实质不利影响的前提下，基金上市后，若上海证券交易所增加交易型开放式指数基金其他业务模式，基金管理人在与基金托管人协商一致后可以增加本基金其他份额，无需召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案后公告。

## 九、基金的费用与税收

### （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、基金的指数许可使用费
- 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、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用、账户开户及维护费用；
- 9、基金上市费及年费；
- 10、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 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

## 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 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

## 3、基金合同生效后的指数许可使用费

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计算方式如下：

指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.03% 的年费率计提。指数许可使用费每日计算，逐日累计，按季支付。计算方法如下：

$$H=E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

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

基金合同生效日所在季度的指数许可使用费，根据实际天数按比例收取。自基金合同生效之日所在季度的下一个季度起，指数许可使用费的收取下限为每季度 5 万元。指数许可使用费将按照上述指数许可协议的约定进行支付。

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“一、基金费用的种类中第 4—10 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；
- 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）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，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, 华宝兴业基金管理有限公司对《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招募说明书》作如下更新:

- 1、“二、释义”更新了基金合同生效的相关信息。
- 2、“三、基金管理人”更新了基金管理人的相关信息。
- 3、“五、相关服务机构”更新了本基金代销机构的相关信息。
- 4、“六、基金的募集”更新了基金募集的情况。
- 5、新增“七、基金合同的生效”，新增基金合同生效的相关信息。
- 6、“九、基金份额的申购与赎回”更新了申购赎回清单的信息。
- 7、“十、基金的投资”更新了截至 2016 年 12 月 31 日的基金的投资组合报告。
- 8、新增“十一、基金的业绩”，新增了截至 2016 年 12 月 31 日的基金业绩数据。
- 9、“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 4 月 14 日