

华宝兴业中证 100 指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

【重要提示】

本基金根据中国证券监督管理委员会《关于核准华宝兴业中证 100 指数证券投资基金募集的批复》(证监许可[2009]754号)的核准,进行募集。

基金合同于 2009 年 9 月 29 日正式生效。

基金管理人保证《华宝兴业中证 100 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

人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。投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证投资于本基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资有风险,投资人申购本基金时应认真阅读本基金招募说明书。

本摘要根据《基金合同》和《招募说明书》编写,经基金托管人审核,并经中国证监会核准。《基金合同》是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。投资人自取得依《基金合同》所发售的基金份额,即成为基金份额持有人和《基金合同》当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对《基金合同》的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定享有权利、承担义务;基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅《基金合同》。

本招募说明书摘要所载内容截止日为 2017 年 9 月 29 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 12 月 31 日,数据未经审计。

一、《基金合同》生效日期

本基金自 2009 年 8 月 26 日到 2009 年 9 月 25 日向个人投资者和机构投

资者同时发售，《基金合同》于 2009 年 9 月 29 日生效。

二、基金管理人

(一)基金管理人概况

基金管理人：华宝基金管理有限公司

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

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

法定代表人：孔祥清

总经理：HUANGXiaoyiHelen（黄小薏）

成立日期：2003 年 3 月 7 日

注册资本：1.5 亿元

电话：021—38505888

传真：021—38505777

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
WarburgPincusAssetManagement,L.P.持有 49%的股份。

(二)主要人员情况

1、董事会成员

孔祥清先生，董事长，硕士，高级会计师。曾任宝钢计财部资金处主办、
主管、副处长，宝钢集团财务有限公司总经理。现任华宝基金管理有限

公司董事长、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。

HUANGXiaoyiHelen（黄小薏）女士，董事，硕士。曾任加拿大TDSecurities 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，先后担任公司营运总监、董事会秘书、副总经理，现任华宝基金管理有限公司总经理。

MichaelMartin 先生，董事，博士。曾任 WachtellLiptonRosenKatz 律师助理；第一波士顿银行董事总经理；瑞银证券董事总经理；

BrooklynNYHoldings 总裁；现任美国华平投资集团全球执行委员会成员、全球金融行业负责人、董事总经理，美国 FinancialEngines 董事、加拿大 DBRS 董事、美国 MarinerFinance 董事。

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

胡光先生，独立董事，硕士。曾任美国俄亥俄州舒士克曼律师事务所律师、飞利浦电子中国集团法律顾问、上海市邦信阳律师事务所合伙人。现任上海胡光律师事务所主任、首席合伙人。

尉安宁先生，独立董事，博士。曾任宁夏广播电视大学讲师，中国社会科学院经济研究所助理研究员，世界银行农业经济学家，荷兰合作银行东北亚区食品农业研究主管，新希望集团常务副总裁，比利时富通银行

中国区 CEO 兼上海分行行长，山东亚太中慧集团董事长。现任上海谷旺投资管理有限公司董事长。

陈志宏先生，独立董事，硕士。曾任毕马威会计师事务所合伙人、普华永道会计师事务所合伙人，苏黎世金融服务集团中国区董事长，华彬国际投资（集团）有限公司高级顾问。

2、监事会成员

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

杨莹女士，监事，本科。曾在三九集团、中国平安保险（集团）股份有限公司、永亨银行（中国）有限公司、中国民生银行工作，现任华宝投资有限公司风控合规部总经理。

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；现任华宝基金管理有限公司营运副总监。

王波先生，监事，硕士。曾任上海证券报记者；现任华宝基金管理有限公司市场总监兼战略策划部总经理。

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。

HUANGXiaoyiHelen（黄小薏）女士，总经理，简历同上。

向辉先生，副总经理，硕士。曾在武汉长江金融审计事务所任副所长、在长盛基金管理有限公司市场部任职。2002 年加入华宝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，现任华宝基金管理有限公司副总经理。

欧江洪先生，副总经理，本科。曾任宝钢集团财务部主办、宝钢集团成本管理处主管、宝钢集团办公室（董事会办公室）主管/高级秘书、宝钢集团办公厅秘书室主任、华宝投资有限公司总经理助理兼行政人事部总经理、党委组织部部长，党委办公室主任、董事会秘书等职务。现任华宝基金管理有限公司副总经理。

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

4、本基金基金经理

陈建华先生，硕士。曾在南方证券上海分公司工作。2007年8月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后在研究部、量化投资部任助理分析师、数量分析师、华宝兴业上证180价值ETF、华宝兴业上证180价值ETF联接基金经理助理，兼任华宝兴业上证180成长ETF、华宝兴业上证180成长ETF联接基金经理助理，2012年12月起任华宝兴业中证100指数型证券投资基金基金经理，2015年4月起任华宝兴业事件驱动混合型证券投资基金基金经理。

5、权益投资决策委员会成员

刘自强先生，投资总监、华宝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。

蔡日荣先生，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、依法募集本基金，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、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》、《证券法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》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)依照法律、行政法规有关规定，由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；

(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，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，保证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、市场开发等相关部门，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。

三、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

1、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)67595096

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。

原玢，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

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、直销机构：

（1）直销柜台

本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

投资者可以通过本公司网上交易直销 e 网金系统办理本基金的申购、赎回、转换等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上交易网址：www.fsfund.com。

2、代销机构

(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

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

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

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

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

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

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

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) 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

(11) 江苏银行股份有限公司

客户电话：96098，40086-96098

公司网址：www.jsbchina.cn

(12) 平安银行股份有限公司

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

(13) 上海浦东发展银行股份有限公司

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

(14) 中信银行股份有限公司

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

联系人：陈国媚

客户电话：95558

公司网址：bank.ecitic.com

(15) 安信证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 号楼 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：杨天枝

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

(16) 渤海证券股份有限公司

办公地址：天津市南开区云际道立达公寓 F 座渤海证券

法定代表人：王春峰

联系人：王星

联系电话：022-28451922

客户电话：4006515988

公司网址：www.ewww.com.cn

(17) 长城证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16-17 层

法定代表人：丁益

联系人：金夏

联系电话：0755-83516289

客户电话：400-6666-888

公司网址：www.cgws.com/cczq/

(18) 长江证券股份有限公司

办公地址：湖北省武汉市新华路特 8 号

法定代表人：尤习贵

联系人：奚博宇、黄美慧

联系电话：021-68751860；027-65799827

客户电话：95579 或 4008-888-999

公司网址：www.95579.com

(19) 北京蛋卷基金销售有限公司

办公地址：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

联系电话：010-61840688

传真：010-61840699

客户电话：4000618518

公司网址：<https://danjuanapp.com/>

(20) 德邦证券股份有限公司

办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：姚文平

联系人：刘熠

联系电话：68761616-8076

传真：862168767981

客户电话：400-8888-128

公司网址：www.tebon.com.cn

(21) 东北证券股份有限公司

办公地址：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

联系人：付静雅

联系电话：0431-82006251

传真：0431-85096795

客户电话：95360

公司网址：www.nesc.cn

(22) 东方证券股份有限公司

办公地址：上海市中山南路 318 号东方国际金融广场 2 号楼 21-29 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：黄静

联系电话：63325888-3137

传真：021-63326729

客户电话：95503

公司网址：www.dfzq.com.cn

(23) 东海证券股份有限公司

办公地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

法定代表人：朱科敏

联系人：王一彦

联系电话：20333910

传真：021-50498871

客户电话：95531

公司网址：www.longone.com.cn

(24) 东吴证券股份有限公司

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

联系人：陆晓

联系电话：0512-62938521

传真：0512-65588021

客户电话：95330

公司网址：www.dwzq.com.cn

(25) 东兴证券股份有限公司

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

(26) 方正证券股份有限公司

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

法定代表人：何其聪

联系人：齐冬妮

联系电话：010-59355807

客户电话：95571

公司网址：www.foundersc.com

(27) 光大证券股份有限公司

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号 3 楼

法定代表人：薛峰

联系人：李晓哲、姚巍、李芳芳

联系电话：021-22169111、021-22169502

传真：021-22169134

客户电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

(28) 广发证券股份有限公司

办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 18 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

联系电话：020-87555888-8333

客户电话：95575 或致电各地营业网点

公司网址：www.gf.com.cn

(29) 国都证券股份有限公司

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层

法定代表人：王少华

联系人：李弢

联系电话：010-84183331

客户电话：400-818-8118

公司网址：www.guodu.com

(30) 中国国际金融股份有限公司

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

(31) 国泰君安证券股份有限公司

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

法定代表人：杨德红

联系人：钟伟镇

联系电话：38032284

传真：021-38670666

客户电话：95521、4008888666

公司网址：www.gtja.com

(32) 国信证券股份有限公司

办公地址：深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦

法定代表人：何如

联系人：李颖

联系电话：(0755)82130833--701266、(0755)82133066

传真：0755-82133952

客户电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

(33) 国元证券股份有限公司

客户电话：4008888777 或 95578

公司网址：www.gyzq.com.cn

(34) 海通证券股份有限公司

办公地址：上海广东路 689 号

法定代表人：周杰

联系人：李楠、涂洋

联系电话：23219061、23219290

客户电话：95553

公司网址：www.htsec.com

(35) 上海好买基金销售有限公司

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：021-20613600

传真：021-68596919

客户电话：400-700-9665

公司网址：www.ehowbuy.com

(36) 和讯信息科技有限公司

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：021-20835879

传真：021-20835788

客户电话：400-920-0022

公司网址：www.licaike.com

(37) 恒泰证券股份有限公司

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

(38) 申万宏源西部证券有限公司

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

法定代表人：李季

联系人：黄莹

联系电话：021-33388211

传真：0991-2301927

客户电话：400-800-0562

公司网址：www.swhysc.com

(39) 华安证券股份有限公司

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座
0327 室

法定代表人：李工

联系人：樊忠亚

联系电话：0551-65161675

传真：0551-65161672

客户电话：95318

公司网址：www.hazq.com

(40) 华宝证券有限责任公司

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 楼

法定代表人：陈林

联系人：胡星煜

联系电话：20515583

传真：021-20515593

客户电话：400-820-9898，021-38929908

公司网址：www.cnhbstock.com

(41) 华宝直销

联系电话：021-38505888-731/732

(42) 华福证券有限责任公司

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

（43）华泰证券股份有限公司

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

联系电话：0755-82492193

客户电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

（44）江海证券有限公司

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

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

（45）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

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：010-83363010

传真：010-83363099

客户电话：400-166-1188

公司网址：<http://8.jrj.com.cn>

(46) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

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>

(47) 上海联泰资产管理有限公司

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：021-52822063

传真：021-52975270

客户电话：4000-466-788

公司网址：www.66zichan.com

(48) 上海陆金所资产管理有限公司

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：021-20665952

传真：021-50783597

客户电话：4008219031

公司网址：www.lufunds.com

(49) 民生证券有限责任公司

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.msizq.com

(50) 中国民族证券有限责任公司

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40F-43F

法定代表人：何亚刚

联系人：齐冬妮

联系电话：010-59355807

客户电话：4008895618

公司网址：www.e5618.com

(51) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

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

(52) 平安证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：曹实凡

联系人：周一涵

联系电话：021-38637436

传真：0755-82435367

客户电话：95511-8

公司网址：www.stock.pingan.com

(53) 山西证券股份有限公司

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：韩笑

联系电话：0351-8686656

传真：0351-8686619

客户电话：95573

公司网址：www.i618.com.cn

(54) 上海证券有限责任公司

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：李俊杰

联系人：邵珍珍

联系电话：021-53686262

传真：021-53686100，021-53686200

客户电话：4008918918、021-962518

公司网址：www.962518.com

(55) 申万宏源证券有限公司

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 40 楼

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

联系电话：021-33388211

传真：021-33388224

客户电话：95523、4008895523

公司网址：www.swhysc.com

(56) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

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：021-60897840

传真：0571-26697013

客户电话：4000-776-123

公司网址：<http://www.fund123.cn/>

(57) 深圳腾元基金销售有限公司

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

(58) 上海天天基金销售有限公司

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: 021-54509998

传真: 021-64385308

客户电话: 400-1818-188

公司网址: www.1234567.com.cn

(59) 浙江同花顺基金销售有限公司

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: 0571-88911818

传真: 0571-86800423

客户电话: 4008-773-772

公司网址: www.5ifund.com

(60) 上海万得投资顾问有限公司

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: 021-51327185

传真: 021-68882281

客户电话: 400-821-0203

(61) 北京新浪仓石基金销售有限公司

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

(62) 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

法定代表人：张志刚

联系人：尹旭航

联系电话：010-63081493

客户电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

(63) 兴业证券股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦

法定代表人：兰荣

联系人：乔琳雪、吴嘉虹

联系电话：021-38565547、021-38565570

客户电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

(64) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

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：010-52855713

传真：010-85894285

客户电话：400-6099-200

公司网址：www.yixinfund.com

(65) 中国银河证券股份有限公司

办公地址：中国北京西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈共炎

联系人：辛国政；邓颜

联系电话：010-83574507；010-66568292

传真：010-66568990

客户电话：95551、400-8888-888

公司网址：www.chinastock.com.cn

(66) 招商证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 3945 层

法定代表人：宫少林

联系人：黄婵君

联系电话：86-755-82960167

客户电话：4008895565 或 95565

公司网址：www.newone.com.cn

(67) 中经北证（北京）资产管理有限公司

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：010-68292745

传真：010-68292941

客户电话：400-600-0030

公司网址：www.bzfunds.com

(68) 中泰证券股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 18 层

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

联系电话：021-20315290

客户电话：95538

公司网址：www.zts.com.cn

(69) 中国中投证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

法定代表人：高涛

联系人：张鹏

联系电话：0755-82023442

客户电话：95532 或 4006008008

公司网址：www.china-invs.cn

(70) 中信建投证券股份有限公司

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：许梦园

联系电话：010-85156398

客户电话：400-8888-108、95587

公司网址：www.csc108.com

(71) 中信期货有限公司

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

(72) 中信证券股份有限公司

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：马静懿

联系电话：010-60833889

传真：010-60836029

客户电话：95548

公司网址：www.cs.ecitic.com

(73) 中信证券（山东）有限责任公司

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

(74) 中银国际证券有限责任公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 31 楼

法定代表人：宁敏

联系人：许慧琳

联系电话：021-20328531

传真：021-50372474

客户电话：400-620-8888

公司网址：www.bocichina.com

(75) 深圳众禄金融控股股份有限公司

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：0755-33227950

传真：0755-33227951

客户电话：400-678-8887

公司网址：www.zlfund.cn

(76) 珠海盈米财富管理有限公司

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

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他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：华宝基金管理有限公司

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 58 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

电话：021—38505888

传真：021—38505777

联系人：章希

（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：(8621)31358666

传真：(8621)31358600

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：张勇

经办注册会计师：薛竞、张勇

五、基金名称

华宝兴业中证 100 指数证券投资基金

六、基金类型

契约型开放式基金

七、基金的投资

（一）本基金投资目标、范围、策略、业绩比较基准和风险收益特征

1、投资目标

本基金通过指数化投资，力争控制本基金的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 0.35%、年跟踪误差不超过 4%，实现对中证 100 指数的有效跟踪，谋求基金资产的长期增值。

2、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,包括中证 100 指数的成份股及其备选成份股、新股(首次公开发行或增发)、债券，以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种（如股票指数期货等），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%—95%，投资于中证 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%—10%（其中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 5%）。

3、投资策略

本基金采用完全复制法进行指数化投资，按照成份股在中证 100 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

本基金股票资产跟踪的标的指数为中证 100 指数。中证 100 指数是由中

证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本股是由沪深 300 指数样本股中挑选总市值最大的 100 只股票组成，具有良好的市场代表性和可投资性，综合的反映了沪深证券市场中最具市场影响力的一批大市值公司的整体状况。

（2）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。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股时，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、流动性等因素挑选同行业的股票进行替代，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

（3）股票指数化投资日常投资组合管理

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。

(4) 新股申购投资策略

本基金将依靠公司投研系统，对新股进行深入分析，确定股票内在价值，结合市场估值水平，来预测上市价格，同时考虑市场利率水平及股票中签率，综合评估新股的投资价值，把握获利机会。

(5) 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、金融债等剩余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。

(6) 其他金融工具投资策略

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。

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用股票指数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，以更好地实现本基金的投资目标。本基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不得应用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。

4、业绩比较基准

中证 100 指数收益率 95%+ 银行同业存款收益率 5%

本基金的标的指数为中证 100 指数，同时考虑股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%，因此本基金设定上述业绩比较基准。

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。

5、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和债券型基金。

（二）投资程序

- 1、投资决策委员会制定整体投资战略。
- 2、量化投资部依托基金管理人整体研究平台，并借鉴外部研究成果的基础上，开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。
- 3、基金经理根据投资决策委员会的投资战略，在量化投资部研究报告的指引下，结合对证券市场、上市公司、投资时机的分析，拟订基金的具体投资计划。
- 4、投资决策委员会对基金经理小组提交的方案进行论证分析，并形成决策纪要。
- 5、根据决策纪要，基金经理构造具体的投资组合及操作方案，交由交易部执行。
- 6、交易部按有关交易规则执行，并将有关信息反馈基金经理小组。
- 7、量化投资部采用量化模型进行成份股权重的测算和跟踪误差的评估，并定期进行基金绩效评估，向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。
- 8、内控审计风险管理部对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责，尤其重点关注基金投资组合的风险状况，包括控制基金投资组

合的市场风险和流动性风险。

（三）投资限制与禁止行为

1、组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

- （1）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%；
- （2）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%；
- （3）本基金股票、债券的投资比例范围为：股票资产占基金资产的比例为 90%—95%，现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%—10%；
- （4）本基金投资于中证 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；
- （5）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；
- （6）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%；
- （7）保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；
- （8）法律法规和基金合同规定的其他限制。

法律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。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。

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。基金托管人对基金投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

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) 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，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；

(9) 法律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。

(四) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利和债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 3、有利于基金财产的安全与增值；
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

(五) 基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

八、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至 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（元）	占基金总资产的比例（%）
----	----	-------	--------------

1	权益投资	646,132,486.80	94.74
---	------	----------------	-------

其中：股票	646,132,486.80	94.74
-------	----------------	-------

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 34,874,137.77 5.11

8 其他资产 981,667.15 0.14

9 合计 681,988,291.72 100.00

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 19,039,847.83 2.80

C 制造业 191,841,018.19 28.19

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 19,102,200.66 2.81

E 建筑业 33,055,500.92 4.86

F 批发和零售业 3,946,376.25 0.58

G 交通运输、仓储和邮政业 13,277,114.19 1.95

H 住宿和餐饮业 --

I 信息传输、软件和信息技术服务业 15,836,077.56 2.33

J	金融业	305,277,389.04	44.86
K	房地产业	36,086,645.30	5.30
L	租赁和商务服务业	2,189,284.80	0.32
M	科学研究和技术服务业	--	--
N	水利、环境和公共设施管理业	3,715,027.22	0.55
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	2,273,262.00	0.33
S	综合	--	--
	合计	645,639,743.96	94.88

(1) 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	446,324.98	0.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	--
E	建筑业	38,778.24	0.01
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	7,639.62 0.00
J	金融业	--
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	492,742.84 0.07

(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	1,027,828	50,990,547.08	7.49
2	600036	招商银行	976,367	23,344,934.97	3.43
3	600519	贵州茅台	47,632	22,475,159.20	3.30
4	601166	兴业银行	1,193,427	20,121,179.22	2.96
5	000651	格力电器	457,678	18,842,603.26	2.77
6	000333	美的集团	427,811	18,412,985.44	2.71
7	600016	民生银行	2,237,897	18,395,513.34	2.70
8	000002	万科 A	644,433	16,091,492.01	2.36
9	601328	交通银行	2,597,140	15,998,382.40	2.35
10	601668	中国建筑	1,391,005	13,464,928.40	1.98

(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	002880	卫光生物	998	75,548.60	0.01
2	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01
3	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
4	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
5	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	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) 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) 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
----	----	-------

1	存出保证金	21,564.95
---	-------	-----------

2	应收证券清算款	-
---	---------	---

3	应收股利	-
---	------	---

4	应收利息	7,082.39
---	------	----------

5	应收申购款	953,019.81
---	-------	------------

6	其他应收款	-
---	-------	---

7	待摊费用	-
---	------	---

8	其他	-
---	----	---

9	合计	981,667.15
---	----	------------

(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

本基金本报告期末积极投资股票不存在流通受限。

九、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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	—	—
----	-------	----------	-----------	--------------	---	---

2009/09/29	2009/12/31	4.86%	1.39%	17.65%	1.63%	-12.79%	-0.24%
------------	------------	-------	-------	--------	-------	---------	--------

2010/01/01	2010/12/31	-19.00%	1.53%	-18.26%	1.50%	-0.74%	0.03%
------------	------------	---------	-------	---------	-------	--------	-------

2011/01/01	2011/12/31	-19.10%	1.21%	-19.84%	1.20%	0.74%	0.01%
------------	------------	---------	-------	---------	-------	-------	-------

2012/01/01	2012/12/31	11.55%	1.16%	10.34%	1.16%	1.21%	0.00%
------------	------------	--------	-------	--------	-------	-------	-------

2014/01/01	2014/12/31	59.10%	1.27%	56.17%	1.26%	2.93%	0.01%
------------	------------	--------	-------	--------	-------	-------	-------

2015/01/01	2015/12/31	-1.90%	2.38%	-1.05%	2.34%	-0.85%	0.04%
------------	------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

2017/01/01	2017/06/30	16.97%	0.55%	14.35%	0.56%	2.62%	-0.01%
------------	------------	--------	-------	--------	-------	-------	--------

2009/09/29 2017/06/30 19.25% 1.46% 22.48% 1.45% -3.23% 0.01%

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：

华宝兴业中证 100 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的历史走势对比图

(2009 年 9 月 29 日至 2017 年 6 月 30 日)

注：基金依法应自成立日期起 6 个月内达到基金合同约定的资产组合，截至 2009 年 11 月 6 日，本基金已完成建仓且达到合同规定的资产配置比例。

十、基金费用概览

(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、基金合同生效后的指数许可使用费；
- 4、基金财产拨划支付的银行费用；
- 5、基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费、诉讼费；

8、基金的证券交易费用；

9、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

(三)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

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：

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

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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15%年费率计提。

计算方法如下：

$H = E \times 0.15\% \times \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金

托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、基金合同生效后的指数许可使用费

指数许可使用费是指数许可使用基点费，指数许可使用基点费的计费时间从本基金合同生效日开始计算；基金合同生效当年，不足 3 个月的，按照 3 个月收费。指数许可使用基点费的收取标准为本基金的资产净值的 0.02%/年，许可使用基点费的收取下限为每季人民币 5 万元（即不足 5 万元部分按照 5 万元收取）。

在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的 0.02% 的年费率计提。指数许可使用基点费每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.02\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应付的指数许可使用基点费，E 为前一日的基金资产净值

指数许可使用基点费的支付方式为每季支付一次，自基金合同生效日起，基金管理人应于每年 1 月，4 月，7 月，10 月的最后一个工作日前，按照双方确认的金额向中证指数有限公司支付上一季度的指数许可使用基点费。

4、除管理费、托管费和指数许可使用费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

(四)不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

十一、《招募说明书》更新部分的说明

根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)及其他有关规定,华宝基金管理有限公司对《华宝兴业中证 100 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、八、基金份额的申购、赎回与转换更新了本基金办理转换业务的代销机构。
- 5、九、基金的投资更新了截至 2017 年 6 月 30 日的基金的投资组合报告。
- 6、十、基金的业绩更新了截至 2017 年 6 月 30 日的基金业绩数据。
- 7、二十二、对基金份额持有人的服务更新了定期定额投资计划的相关内容。

8、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。

华宝基金管理有限公司

2017年11月9日