

华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 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 2018 年 6 月 27 日证监许可【2018】1058 号文注册，进行募集。

基金管理人保证《华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金（LOF）招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。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，流动性风险，本基金特定风险（包括指数化投资风险、上市交易风险、股指期货等金融衍生品投资风险、资产支持证券投资风险、流通受限证券投资风险、参与融资与转融通业务的风险）、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。本基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有投资风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》、《基金合同》、基金产品资料概要等信息披露文件，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

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

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运

营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

本次更新招募说明书根据 2019 年 9 月 1 日生效的《信息披露办法》及《基金合同》、《托管协议》的修订，更新《招募说明书》“重要提示”、“绪言”、“释义”、“基金管理人”、“相关服务机构”、“基金份额的申购与赎回”、“基金收益与分配”、“基金的会计与审计”、“基金的信息披露”、法律文件摘要等章节内容，相关内容截止日为 2019 年 12 月 31 日；有关财务数据和净值表现数据截止日为 2019 年 6 月 30 日，其他所载内容截止日为 2019 年 7 月 24 日，财务数据未经审计。

原招募说明书与本次更新的招募说明书不一致的，以本次更新的招募说明书为准。

本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。

一、《基金合同》生效日期

本基金自 2018 年 11 月 26 日到 2019 年 1 月 18 日向个人投资者和机构投资者同时发售，《基金合同》于 2019 年 1 月 24 日生效。

二、基金管理人

(一) 基金管理人概况

名称：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：HUANG Xiaoyi Helen（黄小薏）

成立日期：2003 年 3 月 7 日

注册资本：1.5 亿元人民币

电话：021-38505888

联系人：章希

股权结构：中方股东华宝信托有限责任公司持有 51% 的股份，外方股东 Warburg Pincus Asset Management, L.P. 持有 49% 的股份。

(二) 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，中国宝武钢铁集团有限公司产业金融党工委副书记、纪工委书记、工会工委主席，法兴华宝汽车租赁（上海）有限公司董事长，华宝信托有限责任公司董事，华宝都鼎（上海）融资租赁有限公司董事长，中国太平洋保险（集团）股份有限公司董事。

HUANG Xiaoyi Helen（黄小薏）女士，董事，硕士。曾任加拿大 TD Securities 公司金融分析师，Acthop 投资公司财务总监。2003 年 5 月加入华宝基金管理有限公司，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。

魏臻先生, 董事。曾任麦肯锡 (上海) 咨询公司分析师, 摩根斯坦利亚洲公司分析师, 香港人人媒体总监。现任华平投资集团董事总经理、神州租车控股公司董事、九月教育集团董事、中通快递董事。

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股份有限公司董事。

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执行董事兼总经理。

林志宏先生, 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、华宝投资有限公司工作, 现任华宝信托有限责任公司风险管理部副总经理。

贺桂先先生 监事, 本科。曾任华宝信托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兼北京分公司总经理兼综合管理部总经理。

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互金业务总监兼互金策划部总经理。

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。

HUANG Xiaoyi Helen (黄小蕙) 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、董事会秘书, 宝钢金融系统党委组织部部长、党委办公室主任。现任华宝基金管理有限公司副总经理。

李慧勇先生, 副总经理, 硕士。曾在上海申银万国证券研究所有限公司担任董事总经理/所长助理/研究执行委员会副主任/首席分析师的职务。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

胡洁, 硕士。2006 年 6 月加入华宝基金管理有限公司, 先后在交易部、产品开发和量化投资部工作, 现任量化投资部副总经理。2012 年 10 月至 2019 年 1 月任上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2012 年 10 月至 2018 年 11 月任华宝上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2015 年 5 月起任华宝中证医疗指数分级证券投资基金基金经理, 2015 年 6 月至 2018 年 8 月任华宝中证 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 月起任华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2017 年 7 月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2018 年 11 月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2019 年 1 月起任华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2019 年 5 月起任华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2019 年 7 月起任华宝中证科技龙头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

闫旭女士, 投资总监、国内投资部总经理、华宝行业精选混合型证券投资基金基金经理、华宝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、华宝宝康消费品证券投资基金基金经理、华宝核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

刘自强先生, 投资总监、华宝动力组合混合型证券投资基金基金经理。

蔡目荣先生, 国内投资部副总经理、华宝多策略增长开放式证券投资基金基金经理、华宝资源优选混合型证券投资基金基金经理、华宝价值发现混合型证券投资基金基金经理、华宝绿色主题混合型证券投资基金基金经理。

曾豪先生, 研究部总经理, 华宝先进成长混合型证券投资基金基金经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

(三) 基金管理人职责

基金管理人应严格依法履行下列职责:

- 1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理本基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额的申购、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)等。

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

(1) 搭建风险管理环境。具体包括制定风险管理战略、目标,设置相应的组织机构、建立清晰的责任线路和报告渠道、配备适当的人力资源、开发适用的技术支持系统等内容。

(2) 识别风险。辨识公司运作和基金管理中存在的风险。

(3) 分析风险。检查存在的控制措施,分析风险发生的可能性及其引起的后果并将风险归类。

(4) 度量风险。评估风险水平的高低,既有定性的度量手段,也有定量的度量手段。定性的度量是把风险水平划分为若干级别,每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别进入相应的级别。定量的方法则是设计一些风险指标,测量其数值的大小。

(5) 处理风险。将风险水平与既定的标准相对比,对于那些级别较低、在公司所定标准范围以内的风险,控制相对宽松一点,但仍加以定期监控,以防其超过预定标准;而对较为严重的风险,则制定适当的控制措施;对于一些后果可能极其严重的风险,则除了严格控制以外,还准备了相应的应急处理措施。

(6) 监视与检查。对已有的风险管理系统进行实时监视,并定期评价其管理绩效,在必要时结合新的需求加以改变。

(7) 报告与咨询。建立风险管理的报告系统,使公司股东、公司董事会、公司高级管理人员及监管部门及时而有效地了解公司风险管理状况,并寻求咨询意见。

2、内部控制制度

(1) 内部风险控制原则

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门和各级岗位,并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节;

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

独立性原则。公司必须在精简高效的基础上设立能充分满足公司经营运作需要的部门和岗位,各部门和岗位在职能上保持相对独立性;公司固有财产、各项委托基金财产、其他资产分离运作,独立进行;

相互制约原则。内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制约,并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点;

防火墙原则。公司基金管理、交易、清算登记、信息技术、研究、市场营销等相关部门,应当在物理上和制度上适当隔离;对因业务需要必须知悉内幕信息的人员,应制定严格的批准程序和监督防范措施;

成本效益原则。公司应当充分发挥各部门及每位员工的工作积极性,尽量降低经营运作成本,保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果;

合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章制度和各项规定,并在此基础上遵循国际和行业的惯例制订;

全面性原则。内部控制制度必须涵盖公司经营管理的各个环节,并普遍适用于公司每一位员工,不留有制度上的空白或漏洞;

审慎性原则。公司内部控制的核心是风险控制,内部控制制度的制订要以审慎经营、防范和化解风险为出发点;

适时性原则。内部控制制度的制订应当具有前瞻性,并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改或完善。

(2) 内部风险控制的要求和内容

内部风险控制要求不相容职务分离、建立完善的岗位责任制和规范的岗位管理措施、建立完整的信息资料保全系统、建立授权控制制度、建立有效的风险防范系统和快速反应机制。

内部风险控制的内容包括投资管理业务控制、市场管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制、档案管理控制、建立保密制度以及内部稽核控制等。

(3) 督察长制度

公司设督察长,督察长由公司总经理提名,董事会聘任,并应当经全体独立董事同意。

督察长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：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：刘连舸

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 2019 年 6 月 30 日，中国银行已托管 716 只证券投资基金，其中境内基金 676 只，QDII 基金 40 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF 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。2017 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。

四、相关服务机构

(一) 基金份额销售机构

1、场外销售机构

1) 直销机构

(1) 直销柜台

名称: 华宝基金管理有限公司

住所、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

联系人: 章希

网址: www.fsfund.com

(2) 直销 e 网金

投资者可以通过华宝基金管理有限公司网上交易直销 e 网金系统办理本基金的认/申购、

赎回、转换等业务，具体交易细则请参阅基金管理人网站公告。网上交易网址：
www.fsfund.com。

2) 其他场外销售机构

(1) 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

邮编：100818

法定代表人：刘连舸

联系人：陈洪源

客户服务电话：95566

公司网址：www.boc.cn

(2) 中国民生银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区西绒线胡同 28 号天安国际办公楼

邮编：100031

法定代表人：洪崎

联系人：王志刚

联系电话：95568

传真：010-57092611

客户服务电话：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

(3) 平安银行股份有限公司

办公地址：广东省深圳市深南东路 5047 号

邮编：518001

法定代表人：谢永林

联系人：戴青

联系电话：95511

客户服务电话：95511-3

公司网址：www.bank.pingan.com

(4) 上海浦东发展银行股份有限公司

办公地址: 上海市中山东一路 12 号

邮编: 200002

法定代表人: 高国富

联系人: 胡子豪

联系电话: 95528

传真: 021-61162165

客户服务电话: 95528

公司网址: www.spdb.com.cn

(5) 深圳前海微众银行股份有限公司

办公地址: 广东省深圳市南山区沙河西路 1819 号深圳湾科技生态园 7 栋 A 座

法定代表人: 顾敏

客户服务电话: 400-999-8800

公司网址: www.webank.com

(6) 诺亚正行基金销售有限公司

联系电话: 400-821-5399

(7) 珠海盈米基金销售有限公司

联系电话: 020-89629099

(8) 上海万得基金销售有限公司

联系电话: 400-821-0203

公司网址: www.520fund.com.cn

(9) 北京百度百盈基金销售有限公司

办公地址: 北京市海淀区上地信息路甲 9 号奎科大厦

联系电话: 95055

公司网址: www.baiyingfund.com

(10) 北京创金启富基金销售有限公司

联系电话: 400-626-2818

(11) 北京汇成基金销售有限公司

联系电话: 400-619-9059

公司网址: <http://www.hcjijin.com/>

(12) 腾安基金销售(深圳)有限公司

联系电话: 95017

公司网址: www.tenganxinxi.com

(13) 奕丰基金销售有限公司

联系电话: 400-684-0500

(14) 上海联泰基金销售有限公司

联系电话: 400-046-6788

(15) 安信证券股份有限公司

办公地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

邮编: 518026

法定代表人: 王连志

联系人: 刘志斌

联系电话: 4008-001-001

客户服务电话: 95517

公司网址: www.essence.com.cn

(16) 渤海证券股份有限公司

办公地址: 天津市南开区宾水西道 8 号(奥体中心北侧)

法定代表人: 王春峰

联系人: 王星

传真: 022-28451958

客户服务电话: 400-651-5988

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

邮编: 518034

法定代表人: 丁益

联系人: 金夏

客户服务电话: 400-6666-888

公司网址: www.cgws.com

(18) 长江证券股份有限公司

办公地址: 湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号

邮编: 430015

法定代表人: 李新华

联系人: 奚博宇

传真: 027-85481900

客户服务电话: 95579

公司网址: www.95579.com

(19) 上海大智慧基金销售有限公司

办公地址: 上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 层

联系人: 裘爱萍

客户服务电话: 021-20219931

公司网址: <https://8.gw.com.cn/>

(20) 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

传真: 010-61840699

客户服务电话: 4000618518

公司网址: <https://danjuanapp.com/>

(21) 东北证券股份有限公司

办公地址: 长春市生态大街 6666 号

邮编: 130118

法定代表人：李福春

联系人：安岩岩

传真：0431-85096795

客户服务电话：95360

公司网址：www.nesc.cn

(22) 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

邮编：215021

法定代表人：范力

联系人：陆晓

联系电话：400-860-1555

传真：0512-62938527

客户服务电话：95330

公司网址：www.dwzq.com.cn

(23) 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：周健男

联系人：李晓哲

联系电话：95525

传真：021-22169134

客户服务电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

(24) 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 10 层

邮编：100007

法定代表人：王少华

联系人：司琪

传真: 010-84183311

客户服务电话: 400-818-8118

公司网址: www.guodu.com

(25) 国海证券股份有限公司

办公地址: 广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人: 何春梅

联系人: 王宁祺

联系电话: 95563

传真: 0755-83704850

客户服务电话: 95563

公司网址: www.ghzq.com.cn

(26) 国金证券股份有限公司

办公地址: 成都市东城根上街 95 号

邮编: 610015

法定代表人: 冉云

联系人: 杜晶

传真: 028-86690126

客户服务电话: 95310

公司网址: www.gjzq.com.cn

(27) 国联证券股份有限公司

办公地址: 无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦

邮编: 214121

法定代表人: 姚志勇

联系人: 祁昊

传真: 0510-82830162

客户服务电话: 95570

公司网址: <http://www.glsc.com.cn>

(28) 国泰君安证券股份有限公司

办公地址：上海市静安区新闻路 669 号博华广场 21 层

邮编：200041

法定代表人：杨德红

联系人：朱雅崑

传真：021-38670666

客户服务电话：95521

公司网址：www.gtja.com

(29) 国信证券股份有限公司

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：李颖

传真：0755-82133952

客户服务电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

(30) 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

联系电话：95553

客户服务电话：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

(31) 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

客户服务电话：400-700-9665

公司网址：www.ehowbuy.com

(32) 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

客户服务电话：400-920-0022

公司网址：www.licaik.com

(33) 恒泰证券股份有限公司

办公地址：呼和浩特市新城区海拉尔东街满世书香苑办公楼 7 楼

邮编：010010

法定代表人：庞介民

联系人：熊丽

客户服务电话：400-196-6188

公司网址：www.cnht.com.cn

(34) 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

邮编：200120

法定代表人：陈林

联系人：刘闻川

传真：021-68777822

客户服务电话：400-820-9898

公司网址：www.cnhbstock.com

(35) 华泰证券股份有限公司

办公地址：南京市江东中路 288 号

邮编：210019

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

传真：021-83387254

客户服务电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

(36) 上海华夏财富投资管理有限公司

客户服务电话: 400-817-5666

(37) 上海基煜基金销售有限公司

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人: 王翔

客户服务电话: 400-820-5369

公司网址: www.jiyufund.com.cn

(38) 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

客户服务电话: 400-166-1188

公司网址: <http://8.jrj.com.cn>

(39) 上海陆金所基金销售有限公司

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

客户服务电话: 4008219031

公司网址: www.lufunds.com

(40) 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

联系电话: 4000-776-123

客户服务电话: 4000-776-123

公司网址: <http://www.fund123.cn/>

(41) 平安证券股份有限公司

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

法定代表人: 何之江

联系人: 周一涵

传真: 0755-82435367

客户服务电话: 95511-8

公司网址: www.stock.pingan.com

(42) 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: 400-891-8918

传真: 021-53686100, 021-53686200

客户服务电话: 400-891-8918

公司网址: www.shzq.com

(43) 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

邮编: 200031

法定代表人: 李梅

联系人: 陈飙

传真: 021-33388224

客户服务电话: 95523

公司网址: www.swhysc.com

(44) 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

邮编: 200031

法定代表人: 李梅

联系人: 陈飙

传真: 021-33388224

客户服务电话: 95523

公司网址: www.swhysc.com

(45) 南京苏宁基金销售有限公司

客户服务电话: 95177

公司网址: www.snjjjin.com

(46) 太平洋证券股份有限公司

办公地址: 北京市西城区北展北街 9 号华远企业号 D 座三单元

法定代表人: 李长伟

联系人: 王婧

客户服务电话: 95397

公司网址: www.tpyzq.com

(47) 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

法定代表人: 曾革

联系人: 杨苗苗

联系电话: 400-877-899

客户服务电话: 4006-877-899

公司网址: www.tenyuanfund.com

(48) 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

客户服务电话: 400-1818-188

公司网址: www.1234567.com.cn

(49) 通华财富(上海)基金销售有限公司

办公地址: 上海市浦东新区金沪路 55 号通华科技大厦 7 层

客户服务电话: 400-101-9301

公司网址: www.tonghuafund.com

(50) 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: 张丽琼

客户服务电话: 4008-773-772

公司网址: www.5ifund.com

(51) 上海挖财基金销售有限公司

客户服务电话: 021-50810673

公司网址: www.wacaijijin.com

(52) 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

客户服务电话: 010-62675369

公司网址: www.xincai.com

(53) 信达证券股份有限公司

办公地址: 北京市西城区宣武门西大街甲 127 号大成大厦 6 层

法定代表人: 张志刚

联系人: 王潇

联系电话: 400-800-8899

传真: 010-63081344

客户服务电话: 95321

公司网址: www.cindasc.com

(54) 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

法定代表人: 杨华辉

联系人: (公邮)

联系电话: 95562

客户服务电话: 95562

公司网址: www.xyzq.com.cn

(55) 宜信普泽(北京)基金销售有限公司

办公地址: 北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

联系电话: 400-6099-200

客户服务电话: 400-6099-200

公司网址: www.yixinfund.com

(56) 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

邮编：100033

法定代表人：陈共炎

联系人：辛国政

传真：010-83574807

客户服务电话：4008-888-888 或 95551

公司网址：www.chinastock.com.cn

(57) 招商证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦 23 楼

邮编：518033

法定代表人：霍达

联系人：黄婵君

联系电话：95565

传真：0755-82943227

客户服务电话：95565

公司网址：www.newone.com.cn

(58) 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：朱琴

传真：021-20315125

客户服务电话：95538

公司网址：www.zts.com.cn

(59) 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: 胡芷境

传真: 0755-82026539

客户服务电话: 95532 或 400-600-8008

公司网址: www.china-invs.cn

(60) 中信建投证券股份有限公司

办公地址: 北京东城区朝内大街 2 号凯恒中心 B 座 18 层

法定代表人: 王常青

联系人: 许梦园

客户服务电话: 95587

公司网址: www.csc108.com

(61) 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

法定代表人: 张皓

联系人: 刘宏莹

联系电话: 010-60838677

传真: 0755-83217421

客户服务电话: 400-990-8826

公司网址: www.citicsf.com

(62) 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

邮编: 100026

法定代表人: 张佑君

联系人: 马静懿

传真: 010-60833739

客户服务电话: 95548

公司网址: www.cs.ecitic.com

(63) 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

邮编: 100026

法定代表人: 张佑君

联系人: 马静懿

传真: 010-60833739

客户服务电话: 95548

公司网址: www.cs.ecitic.com

(64) 中银国际证券股份有限公司

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 31 楼

邮编: 200120

法定代表人: 宁敏

联系人: 许慧琳

联系电话: 400-620-8888

传真: 021-50372474

客户服务电话: 400-620-8888

公司网址: www.bocichina.com

(65) 深圳众禄基金销售股份有限公司

办公地址: 深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼

联系电话: 400-678-8887

客户服务电话: 400-678-8887

公司网址: www.zlfund.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。

(2) 其它场外销售机构情况详见基金份额发售公告及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构, 并在基金管理人网站公示。

2、场内销售机构

本基金办理场内认购、申购和赎回业务的销售机构为具有基金销售业务资格、并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员。具体会员单位名单可在上海证券交易所网站查询。

本基金募集结束前获得基金销售资格的上海证券交易所会员单位可通过上海证券交易所系统办理本基金的场内认购业务。基金管理人将不就此事项进行公告。

(二) 登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系电话：010-58598839

传真：010-58598907

联系人：朱立元

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

联系电话：(86 21) 3135 8666

传真：(86 21) 3135 8600

联系人：丁媛

经办律师：黎明、丁媛

(四) 审计基金财产的会计师事务所

名称：德勤华永会计师事务所 (特殊普通合伙)

注册地址：中国上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼

办公地址：中国上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼

执行事务合伙人：曾顺福

联系电话：（021） 61418888

传真：（021） 63350177

联系人：曾浩

经办注册会计师：曾浩、冯适

五、基金简介

基金名称：华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金（LOF）

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最小化。正常情况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。

（二）投资范围

本基金的投资范围包括标的指数成份股、备选成份股、国内依法发行上市的其他股票（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（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及经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。

本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。

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

基金的投资组合比例为：

本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券。

（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

本基金主要采取完全复制法，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

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的同时有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变动走势，并利用债券定价技术，进行个券选择。

4、资产支持证券投资策略

本基金将通过对宏观经济、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同，控制信用风险和流动性风险的前提下，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

5、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

6、融资及转融通投资策略

本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上, 审慎参与融资及转融通业务。本基金将根据市场情况和组合风险收益, 确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资及转融通业务的法律法规发生变化, 本基金将从其最新规定, 以符合上述法律法规和监管要求的变化。

7、其他金融工具投资策略

如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他金融产品, 基金管理人将根据监管机构的规定及本基金的投资目标, 在履行适当程序后制定与本基金相适应的投资策略、比例限制、信息披露方式等。

(四) 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及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%, 且投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%;
- (2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 基金保留的现金 (不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等) 或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%;
- (3) 本基金持有的全部权证, 其市值不得超过基金资产净值的 3%;
- (4) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证, 不得超过该权证的 10%;
- (5) 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;
- (6) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过基金资产净值的 10%;
- (7) 本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过基金资产净值的 20%;
- (8) 本基金持有的同一 (指同一信用级别) 资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的 10%;
- (9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券, 不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;

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

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

(12) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%; 在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年, 债券回购到期后不展期;

(13) 本基金参与股指期货交易, 应当遵守下列要求:

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

2) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 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;

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

4) 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;

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

(14) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;

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

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

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

(18) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(19) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(20) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

除上述第 (2)、(10)、(18)、(19) 项外，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。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

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

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全

内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

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

(五) 标的指数和业绩比较基准

本基金的标的指数为标普中国 A 股质量价值指数。

本基金的业绩比较基准为标普中国 A 股质量价值指数收益率 $\times 95\%$ +人民币银行活期存款利率(税后) $\times 5\%$ 。

标普中国 A 股质量价值指数通过质量指标和价值指标进行两层筛选,选出 A 股市场中高质量低估值的 100 只股票组成成分股。质量指标由公司的股本回报率、资产负债表应记率、金融杠杆率构成,价值指标打分由市盈率、市净率、市销率构成。

如果指数编制单位变更或停止标普中国 A 股质量价值指数的编制、发布或授权,或标普中国 A 股质量价值指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致标普中国 A 股质量价值指数不宜继续作为标的指数,或者今后法律法规发生变化,证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,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,按监管部门要求履行适当程序以后变更标的指数、业绩比较基准、基金名称等并及时公告。其中,若变更标的指数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,并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项),则该等变更无须召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致后,报中国证监会备案并及时公告。

(六) 风险收益特征

本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金,具有与标的指数相似的风险收益特征。

(七) 基金管理人代表基金行使股东权利和债权人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。

(八) 基金投资组合报告

本基金投资组合报告所载数据截至 2019 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 | 51,500,016.12 | 92.79 |
| | 其中：股票 | 51,500,016.12 | 92.79 |
| 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 | 3,713,358.72 | 6.69 |
| 8 | 其他资产 | 286,161.24 | 0.52 |
| 9 | 合计 | 55,499,536.08 | 100.00 |

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末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 | 431,613.00 | 0.79 |
| B | 采矿业 | 339,872.00 | 0.62 |
| C | 制造业 | 36,150,554.40 | 66.25 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 474,192.00 | 0.87 |
| E | 建筑业 | 2,172,900.00 | 3.98 |
| F | 批发和零售业 | 2,235,229.00 | 4.10 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 279,676.00 | 0.51 |
| H | 住宿和餐饮业 | 139,779.00 | 0.26 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,587,207.00 | 2.91 |
| J | 金融业 | 867,064.00 | 1.59 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| K | 房地产业 | 2,517,930.80 | 4.61 |
| L | 租赁和商务服务业 | 624,670.00 | 1.14 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 571,004.00 | 1.05 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 370,244.00 | 0.68 |
| 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 | 2,547,372.00 | 4.67 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 51,309,307.20 | 94.03 |

(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 | 采矿业 | 34,385.30 | 0.06 |
| C | 制造业 | 97,369.60 | 0.18 |
| 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 | 25,084.08 | 0.05 |
| J | 金融业 | 33,869.94 | 0.06 |
| 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 | - | - |

| | | | |
|---|---------------|------------|------|
| 0 | 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 | 190,708.92 | 0.35 |

(3) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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 | 600801 | 华新水泥 | 128,360 | 2,599,290.00 | 4.76 |
| 2 | 000651 | 格力电器 | 47,000 | 2,585,000.00 | 4.74 |
| 3 | 600031 | 三一重工 | 192,400 | 2,516,592.00 | 4.61 |
| 4 | 600585 | 海螺水泥 | 60,600 | 2,514,900.00 | 4.61 |
| 5 | 600150 | 中国船舶 | 93,200 | 2,199,520.00 | 4.03 |
| 6 | 000999 | 华润三九 | 47,400 | 1,390,716.00 | 2.55 |
| 7 | 600252 | 中恒集团 | 377,500 | 1,106,075.00 | 2.03 |
| 8 | 002035 | 华帝股份 | 86,600 | 1,054,788.00 | 1.93 |
| 9 | 000636 | 风华高科 | 84,800 | 1,026,080.00 | 1.88 |
| 10 | 300418 | 昆仑万维 | 69,200 | 890,604.00 | 1.63 |

(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 | 300782 | 卓胜微 | 371 | 40,409.32 | 0.07 |
| 2 | 600968 | 海油发展 | 9,686 | 34,385.30 | 0.06 |
| 3 | 601236 | 红塔证券 | 9,789 | 33,869.94 | 0.06 |
| 4 | 603867 | 新化股份 | 1,045 | 26,971.45 | 0.05 |
| 5 | 601698 | 中国卫通 | 6,399 | 25,084.08 | 0.05 |

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) 质量价值指数基金截至 2019 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的风华高科 (000636) 于 2018 年 9 月 10 日收到深交所通报批评。由于公司存在：2018 年 4 月 28 日，风华高科披露的《关于前期会计差错更正及追溯调整的公告》显示，其于 2016 年度转让的部分应收债权并未实质发生转让且转让时应收债权已预计难以按期收回。风华高科对上述债权转让及相关前期会

计差错事项按照追溯重述法进行了更正, 2016 年度归属于上市公司股东的净利润及留存收益因此调 5,279.55 万元, 占风华高科披露的 2016 年度归属于上市公司股东的净利润的 38.01%。本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析, 认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响, 因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内, 本基金投资的前十名证券的其余九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 | 38,528.94 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 828.97 |
| 5 | 应收申购款 | 246,803.33 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 286,161.24 |

(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 | 601236 | 红塔证券 | 33,869.94 | 0.06 | 新股锁定 |

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因, 合计数可能不等于分项之和。

七、基金的业绩

基金业绩截止日为 2019 年 6 月 30 日。基金过往业绩不代表未来表现, 本报告中所列数据未经审计。本基金净值增长率与同期比较基准收益率比较如下:

| 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 |
|-----------------------|------------|---------------|----------------|-------------------|---------|--------|
| 2019/01/24-2019/06/30 | 1.30% | 1.37% | 14.85% | 1.63% | -13.55% | -0.26% |

八、基金份额的申购和赎回

(一) 申购与赎回的场所

基金合同生效后, 投资者可通过场外、场内两种方式对基金份额进行申购与赎回。

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。

投资者可使用开放式基金账户, 通过基金管理人的直销中心和其他场外销售机构, 办理本基金的场外申购与赎回业务。

投资者也可使用上海证券账户, 通过上海证券交易所系统办理本基金的场内申购与赎回业务。场内申购和赎回业务的场所为具有基金销售业务资格且具有相应业务资格的上海证券交易所会员单位。

具体的基金销售机构将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构, 并在基金管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

(二) 申购与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/期货交易市场、证券/期货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相关公告中规定。

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相关公告中规定。

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。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的,其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

(三) 申购与赎回的原则

1、“未知价”原则,即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算;

2、“金额申购、份额赎回”原则,即申购以金额申请,赎回以份额申请;

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销;

4、场外赎回遵循“先进先出”原则,即按照投资者认购、申购的先后次序进行顺序赎回;

5、场内申购与赎回业务遵循上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定。若相关法律法规、中国证监会、上海证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务等规则有新的规定,按新规定执行。

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) 申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资者必须根据销售机构规定的程序,在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

2、申购和赎回的款项支付

投资者申购基金份额时, 必须全额交付申购款项, 投资者交付申购款项, 申购申请即为成立; 登记机构确认基金份额时, 申购生效。若资金在规定时间内未全额到账则申购不成立, 申购款项将退回投资者账户, 基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的利息等损失。

基金份额持有人递交赎回申请, 赎回成立; 登记机构确认赎回时, 赎回生效。

投资者赎回申请成功后, 基金管理人将在 T+7 日 (包括该日) 内支付赎回款项。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时, 款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程, 则赎回款项的划付相应顺延至该因素消除的最近一个工作日。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日 (T 日), 在正常情况下, 本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请, 投资者应在 T+2 日后 (包括该日) 及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功, 则申购款项退还给投资者。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功, 而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况, 投资者应及时查询。

4、基金管理人可以在法律法规允许的范围内, 对上述业务的确认及办理的时间和程序进行调整, 并提前公告。

(五) 申购与赎回的数量限制

1、投资者通过其他场外销售机构和直销 e 网金申购本基金单笔最低金额为 1 元人民币 (含申购费)。通过直销柜台首次申购的最低金额为 10 万元人民币 (含申购费), 追加申购最低金额为每笔 1 元人民币 (含申购费)。已有认购本基金记录的投资者不受首次申购最低金额的限制, 但受追加申购最低金额的限制。场外销售机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的, 以各场外销售机构的业务规定为准。

2、投资者通过场内销售机构申购时, 单笔申购申请的最低金额为 1,000 元, 且申购申请的金额必须为 1 元的整数倍。

3、其他销售机构的投资者欲转入直销柜台进行交易要受直销柜台最低金额的限制。基金管理人可根据市场情况, 调整首次申购的最低金额。

4、投资者可多次申购，对单个投资者累计持有份额不设上限限制，但法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外。

5、投资者可将其全部或部分基金份额赎回。本基金按照份额进行赎回，单笔赎回份额不得低于 1 份。基金份额持有人赎回时或赎回后在某一销售机构的某一交易账户内保留的基金份额余额不足 1 份的，在赎回时需一次全部赎回。

6、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。

7、对于场内申购、赎回及持有场内份额的数量限制，上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则有规定的，从其最新规定办理。

8、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制、投资者每个基金交易账户的最低基金份额余额限制、单个投资者累计持有的基金份额上限、单个投资者单日或单笔申购金额上限、本基金总规模限额和单日净申购比例上限等。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

(六) 申购与赎回费用

1、申购费用

本基金采取前端收费模式收取基金申购费用。投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。本基金的申购费率表如下，场内申购费率与场外申购费率相同。

| 申购金额 (元) | 申购费率 |
|---------------------|---------------|
| 100 万以下 | 1.00% |
| 大于等于 100 万，小于 200 万 | 0.60% |
| 200 万 (含) 以上 | 按笔收取，1000 元/笔 |

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

2、赎回费用

本基金的赎回费率表如下，场内赎回费率与场外赎回费率相同。

| 持有基金份额期限 | 赎回费率 |
|----------|------|
|----------|------|

| | |
|-------------------|-------|
| 小于 7 日 | 1.5% |
| 大于等于 7 日, 小于 6 个月 | 0.50% |
| 大于等于 6 个月, 小于 1 年 | 0.25% |
| 大于等于 1 年 | 0 |

注: 此处一月按 30 日计算, 一年按 365 日计算

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担, 在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产。对持续持有期大于或等于 7 日的投资者收取的赎回费, 不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产, 其余用于支付登记结算费和其他必要的手续费。

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

4、在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下, 基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划, 定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间, 按相关监管部门要求履行必要手续后, 基金管理人可以适当调低基金的各项销售费率。

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

(七) 申购份额、赎回金额与基金份额净值的计算

1、申购份额的计算方式

本基金的场外、场内申购均采用金额申购的方式, 申购金额包括申购费用和净申购金额。

申购费用适用比例费率时:

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

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

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日的基金份额净值}$$

申购费用适用固定金额时:

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

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

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日的基金份额净值}$$

场外申购份额计算结果按四舍五入方法, 保留到小数点后 2 位, 由此产生的收益或损失由基金财产承担; 场内申购份额计算结果先按四舍五入的原则保留到小数点后两位, 再按截位法保留到整数位, 小数部分对应的剩余金额由场内销售机构退还投资者。申购费用、净申购金额的计算按四舍五入方法, 保留到小数点后两位, 由此误差产生的收益或损失由基金资产承担。

例: 假定某投资者投资 100,000 元通过场外本基金, 对应的申购费率为 1.0%, 申购当日的基金份额净值为 1.0861 元, 该投资者可得到的基金份额为:

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.0\%) = 99,009.90 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 99,009.90 = 990.10 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 99,009.90 / 1.0861 = 91,160.94 \text{ 份}$$

即: 投资者投资 100,000 元通过场外申购本基金, 假定申购当日的基金份额净值为 1.0861 元, 可得到 91,160.94 份基金份额。

例: 假定某投资者投资 100,000 元通过场内申购基金份额, 对应的申购费率为 1.0%, 申购当日的基金份额净值为 1.0861 元, 该投资者可得到的基金份额为:

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.0\%) = 99,009.90 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 99,009.90 = 990.10 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 99,009.90 / 1.0861 = 91,160.94 \text{ 份} = 91,160 \text{ 份}$$

$$\text{退款金额} = 0.94 \times 1.0861 = 1.02 \text{ 元}$$

即: 投资者投资 100,000 元通过场内申购基金份额, 假定申购当日的基金份额净值为 1.0861 元, 可得到 91,160 份基金份额, 退款金额为 1.02 元。

2、赎回金额的计算方式

本基金的场外、场内赎回均采用份额赎回的方式。赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中,

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

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

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

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

例: 某投资者通过场外赎回 10,000 份基金份额, 持有期限 9 个月, 对应的赎回费率为 0.25%, 假设赎回当日基金份额净值是 1.1615 元, 则其可得到的赎回金额为:

$$\text{赎回总额} = 10,000 \times 1.1615 = 11,615.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 11,615 \times 0.25\% = 29.04 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 11,615 - 29.04 = 11,585.96 \text{ 元}$$

即：某投资者通过场外赎回 10,000 份基金份额，持有期限 9 个月，对应的赎回费率为 0.25%，假设赎回当日基金份额净值是 1.1615 元，则其可得到的赎回金额为 11,585.96 元。

3、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。

4、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

(八) 拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。

3、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。

4、基金管理人接受某笔或某些申购申请会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

5、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。

6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记结算系统、证券登记系统或基金会计系统无法正常运行。

7、指数编制单位或指数发布机构因异常情况使指数数据无法正常计算、计算错误或发布异常时。

8、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。

9、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、7、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资者的申购申请时，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, 被拒绝的申购款项将退还给投资者。发生上述第 8 项情形时, 基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制, 基金管理人有权拒绝该等全部或部分申购申请。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款项的情形

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款项:

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时, 经与基金托管人协商确认后, 基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、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。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、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, 可暂停接受投资者的赎回申请。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项时, 基金管理人应在当日报中国证监会备案, 已确认的赎回申请, 基金管理人应足额支付; 如暂时不能足额支付, 对于场外赎回申请, 应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人, 未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形, 按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。出现暂停赎回或延缓支付赎回款项时, 场内赎回申请按照上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则办理。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公告。

(十) 巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请 (赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额) 超过前一开放日的基金总份额的 10%, 即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的场外处理方式

当基金出现巨额赎回时,基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

(1) 全额赎回:当基金管理人认为有能力支付投资者的全部赎回申请时,按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回:当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为因支付投资者的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下,可对其余赎回申请延期办理。

若基金发生巨额赎回,在单个基金份额持有人超过基金总份额 20%以上的赎回申请情形下,本基金将按照以下规则实施延期办理赎回申请:发生上述延期办理的,若存在单个赎回申请人当日申请赎回的份额超过前一工作日基金总份额 20% (“大额赎回申请人”)的情形,基金管理人应当按照保护其他赎回申请人 (“普通赎回申请人”)利益的原则,优先确认普通赎回申请人的赎回申请,在当日可接受赎回的范围内对普通赎回申请人的赎回申请予以全部确认或按单个账户赎回申请量占普通赎回申请人赎回申请总量的比例确认;在普通赎回申请人的赎回申请全部确认且当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下,在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例确认。

对于未能赎回部分,投资者在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择,投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

(3) 暂停赎回:连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受基金的赎回申请;已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但不得超过 20 个工作日,并应当在指定媒介上进行公告。

3、巨额赎回的场内处理方式

当出现巨额赎回时,场内赎回申请按照上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司相应规则进行处理。

4、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时,基金管理人应当通过邮寄、传真、通过销售机构告知等其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

(十一) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过 1 日，基金管理人可以按照《信息披露办法》的有关规定自行确定在指定媒介上刊登基金暂停公告的次数，并应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个工作日的基金份额净值。

(十二) 基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

(十三) 基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资者。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

(十四) 基金份额的登记和转托管

1、基金份额的登记

(1) 本基金的基金份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的基金份额，登记在登记结算系统中基金份额持有人开放式基金账户下；场内认购、申购、买入或通过跨系统转托管从场外转到场内的基金份额，登记在证券登记系统基金份额持有人上海证券账户下。

(2) 登记在证券登记系统中的基金份额，可以直接申请场内赎回或在本基金上市后在上海证券交易所上市交易。

(3) 登记在登记结算系统中的基金份额，可以直接申请场外赎回，也可以办理跨系统转托管转至证券登记系统后，在上海证券交易所上市交易。

2、基金份额的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管。本基金的转托管包括系统内转托管和跨系统转托管。

(1) 系统内转托管

1) 系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记系统内不同会员单位(交易单元)之间进行转托管的行为。

2) 基金份额登记在登记结算系统的基金份额持有人在变更办理基金份额赎回业务的销售机构(网点)时,须办理已持有基金份额的系统内转托管。

3) 募集期内不得办理系统内转托管。

(2) 跨系统转托管

1) 跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管的行为。

2) 跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司及上海证券交易所的相关规定办理。

(3) 基金销售机构可以按照相关规定向基金份额持有人收取转托管费。

(4) 本基金上市前、权益分派期间、上海证券交易所规定相应停牌日期、基金份额处于质押、冻结状态或出现上海证券交易所、登记机构规定的其他情形时,不得办理跨系统转托管。

(十五) 定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划,具体规则由基金管理人另行规定。投资者在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额,每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

(十六) 基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻,以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

(十七) 基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下,在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,基金管理人在履行适当的程序后,可受理基金份额持有人通过中国证监会认可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。

(十八) 基金份额的质押

如相关法律法规允许, 在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下, 基金管理人在履行适当的程序后, 可以办理基金份额的质押业务, 基金管理人可制定和实施相应的业务规则。

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、标的指数使用相关费用;
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费;
- 6、基金份额持有人大会费用;
- 7、基金的证券/期货交易费用;
- 8、基金的银行汇划费用;
- 9、账户开户费用和账户维护费;
- 10、基金上市费用和年费;
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定, 可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.75% 年费率计提。管理费的计算方法如下:

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提, 逐日累计至每个月月末, 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。若遇不可抗力致使无法按时支付的, 支付日期顺延至最近可支付日。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。

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 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下:

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

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, 逐日累计至每个月月末, 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。若遇不可抗力致使无法按时支付的, 支付日期顺延至最近可支付日。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。

3、标的指数使用相关费用

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数许可使用协议的约定计提标的指数使用相关费用, 基金合同生效后的标的指数使用相关费用从基金财产中列支。本基金的标的指数使用相关费用包括标的指数许可使用费和标的指数数据使用费。

(1) 标的指数许可使用费

标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

若任一年度累计计提指数许可使用费金额小于指数许可使用协议规定的年度费用下限, 则基金于该年度最后一日补提标的指数许可使用费至指数使用许可协议规定的费用收取下限, 本基金标的指数许可使用费收取下限为每年 30,000 美元。

(2) 标的指数数据使用费

标的指数数据使用费每日计提, 每年 3,000 美元。计算方法如下:

$H=3,000 \times \text{中国人民银行公布的人民币兑美元汇率中间价} \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的指数数据使用费

标的指数数据使用费每日以人民币计提, 按年度支付。若由于汇率影响当年计提的标的指数数据使用费高于或低于 3,000 美元, 则基金与该年度最后一日调整计提的数据使用费至 3,000 美元。

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

如果指数许可使用协议约定的指数许可使用费和指数数据使用费的计算方法、费率和支付方式发生调整, 本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费和指数数据使用费。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒介进行公告, 此项调整无须召开基金份额持有人大会。

上述“(一) 基金费用的种类”中第 4—11 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》)、《公开募集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《华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书》作如下更新:

- 1、根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及修订的基金合同更新“重要提示”、“绪言”、“释义”等章节中《信息披露办法》的名称、新增有关产品资料概要的释义与相关内容。
- 2、根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及修订的基金合同、托管协议更新“基金管理人”、“相关服务机构”、“基金份额的申购与赎回”、“基金收益与分配”、“基金的会计与审计”、“基金的信息披露”、法律文件摘要等章节相关内容。

上述内容仅为摘要,须与本《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

2019 年 12 月 31 日