汇添富恒生指数分级证券投资基金更新招募说明书

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

重要提示

本基金经2013年9月25日中国证券监督管理委员会证监许可【2013】1247号文核准募集。本基金基金合同于2014年3月6日正式生效。

基金管理人保证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。

本基金主要投资于香港证券市场,基金净值会因为香港证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,理性判断市场,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、汇率风险;基金所投资的股票、债券、衍生品等各种投资工具的相关风险;由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险;本基金的特定风险、分级份额投资者特有的风险等。(详见招募说明书“风险揭示”章节)。本基金属于股票型基金,其风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。此外,本基金作为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪标的指数市场表现,目标为获取市场平均收益,是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。

本基金的分级设定则决定了不同份额具有不同的风险和收益特征。恒生A份额具有低风险、低预期收益的特征;恒生B份额具有高风险、高预期收益的特征。由于本基金投资的恒生指数成分股在香港交易所上市交易,根据香港交易所对于股票价格涨跌幅不设限制的交易规则,添富恒生的份额净值每日涨跌幅亦不受限制,故本基金的预期风险、预期收益较当前沪深交易所上市交易的普通股票指数型基金更大。特别的,当恒生指数发生日内巨幅下跌,以致恒生B份额的参考净值跌至负值的情况下,恒生B份额投资者损失所有本金,剩余亏损由恒生A份额投资者承担。因恒生B份额较基础份额(添富恒生)的风险更大。而基于以上风险条件,具有固定收益特性的恒生A份额既不保证收益也不保证本金不受亏损,风险小于基础份额,高于当前深圳证券交易所运行的普通股票型分级证券投资基金的稳健收益份额。

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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据本基金的基金合同和本基金的基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。本基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为本基金份额持有人和本基金合同当事人,其持有本基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解本基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2014年9月6日,有关财务数据和净值表现截止日为2014年6月30日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

一、基金名称

汇添富恒生指数分级证券投资基金

二、基金的类别与运作方式

基金类型为股票型证券投资基金,基金运作方式为契约型开放式

三、投资目标

紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

四、投资范围

本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标,基金还可投资于债券、基金(包括股票基金、债券基金、交易所交易基金等)、金融衍生工具(包括远期合约、互换、期货、期权、权证等),符合证监会要求的银行存款等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金非现金资产的80%。

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

五、投资策略

(一)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对个别成份股足够数量的投资时,基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股、成份股个股衍生品等方式进行替代。

3、衍生品投资策略

由于本基金申购赎回采取现金方式,考虑到申购赎回资金流动冲击以及外汇汇兑、资金划转的操作问题,基金将会保留一定的现金头寸用于满足赎回及香港证券交收要求,现金头寸的增加将导致跟踪误差的扩大,因此基金管理人将通过投资以标的指数为基础资产的衍生产品(如期货、掉期等)以更好地跟踪标的指数,实现投资目标。

本基金力争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%。

未来,随着投资工具的发展和丰富,基金管理人可以在不改变投资目标的前提下,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。

(二)投资决策机制和程序

1、投资决策依据

(1)国家有关法律、法规和《基金合同》的规定;

(2)标的指数的相关规定;

(3)《汇添富基金管理股份有限公司章程》的有关规定;

(4)《汇添富基金管理股份有限公司投资管理制度》的有关规定。

2、投资决策机制

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

(1)投资决策委员会的主要职能:

本基金管理人设立的投资决策委员会是本基金投资的最高决策机构。投资决策委员会的主要职责包括:

1)负责决定有关指数重大调整的应对决策;

2)负责决定其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策;

3)审核评估基金经理每季提交的投资运作季报。

(2)基金经理的主要职责

基金经理的主要职责包括:

1)决定正常市场情况下,日常指数跟踪过程中的组合构建、调整决策以及日常管理等工作;

2)必要时进行本基金跟踪偏离的分析;

3)每季向投资决策委员会提交本基金的投资运作季报;

4)撰写基金中报、年报等公开报告关于基金投资运作的相关部分。

3、投资决策程序

本基金投资程序分为投资研究、投资决策、投资执行(组合构建与监控调整)、交易执行、投资绩效评估、投资核对与监督、组合监控与调整、投资风险管理八个环节。

(1)研究支持

指数投资管理小组依托基金管理人整体研究平台,整合内外部的信息和研究成果,开展对标的指数的跟踪研究、对标的指数成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、对标的指数成份股流动性分析、对基金的跟踪误差及时进行时间分析等工作,并撰写相关研究报告,作为基金投资决策的重要依据。

(2)投资决策

投资决策委员会依据指数投资管理小组提供的研究报告,定期或遇重大事项时召开投资决策会议,决定相关事项。基金经理在投资决策委员会决议的基础上,进行基金投资管理的日常决策。

定期事项是指:每季初投资决策委员会对基金的操作进行指导与决策,基金经理根据公司投资决策委员会的决策开展下一阶段的工作;

(3)投资执行(组合构建与监控调整)

根据标的指数,结合指数投资管理小组的研究报告,基金经理以完全复制标的指数的方法构建组合。在跟踪误差和偏离度最小化的前提下,基金经理将采取适当的方法,降低买入成本、控制投资风险。

(4)交易执行

集中交易室负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

(5)风险监控:风险控制人员根据交易风险监控系统,在交易期间对指数基金的各类风险源进行监控,一旦发现异常立即通知基金经理,基金经理将根据风险的具体情况,确定相应的应急操作方案。

(6)投资绩效评估

金融工程岗定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关报告。绩效评估将确认组合是否实现了投资预期、对跟踪误差和业绩偏离的来源进行分析,基金经理可以据此检视投资策略,进而调整投资组合。

1)不定期的,基金经理对基金出现的较大的跟踪偏离进行及时分解和分析;

2)每周末,数量分析师对本基金的运行情况进行量化评估;

3)每月末,基金经理根据评估报告分析当月的投资操作和跟踪指数的偏离情况,主要对组合跟踪偏离和跟踪误差、现金控制情况、成份股更新期的投资操作以及成份股未来可能发生的变化进行分析并提供相关报告,作为今后投资运作的参考依据。

在正常市场情况下,本基金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%。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,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

(7)投资核对与监督

基金营运部基金会计通过交易数据的核对,对当日交易操作进行复核,如发现有违反《证券法》、《证券投资基金法》、《基金合同》、公司相关管理制度的交易操作,须立刻向投资总监汇报,并同时通报督察长、稽核监察部及基金经理。

集中交易室负责对基金投资的日常交易行为进行实时监控。

督察长和稽核监察部对投资决策和投资执行的过程进行合规性监督检查,有权调阅任何数据和资料,防止在投资管理过程中的违规风险。

(8)投资风险管理

投资风险管理是基金投资管理的重要环节,公司根据投资决策的不同层次建立完善的基金风险控制系统。

基金投资风险管理包括对投资组合规性风险的管理以及对投资组合风险的管理:

1)公司风险管理委员会定期不定期对公司投资管理制度、投资决策程序的合法性、合规性、有效性及基金运作过程中的合法性、合规性进行全面检查评价,如发现问题,应责成公司相关部门提出改进方案并落实。

2)风险管理委员会和金融工程部通过审议本基金的投资运作季报,以及对日常投资的跟踪监控,从而控制本基金的投资组合风险。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整,并在基金招募说明书及其更新中公告。

(三)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、备选成份股的资产比例不低于基金非现金资产的80%;

(2)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;

(3)本基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的20%,其中银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行。在基金托管账户的存款可以不受上述限制;

(4)本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的10%,其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的3%;

(5)基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的10%;

前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

(6)本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金资产净值的10%,但持有货币市场基金不受此限制;

(7)同一基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金,不得超过该境外基金总份额的20%;

(8)为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的10%;

(9)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。

若基金超过上述3-8项投资比例限制,应当在超过比例后30个工作日内采用合理的商业措施减仓以符合投资比例限制要求。

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,不需经基金份额持有人大会审议。

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)购买不动产;

(5)购买房地产抵押按揭;

(6)购买贵重金属或代表贵重金属的凭证;

(7)购买实物商品;

(8)除应付赎回、交易清算等临时用途以外,借入现金;

(9)利用融资购买证券,但投资金融衍生品除外;

(10)参与未持有基础资产的卖空交易;

(11)购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层;

(12)直接投资与实物商品相关的衍生品;

(13)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;

(14)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;

(15)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;

(16)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。

对于因上述13、14项情形导致无法投资的标的指数成份股或备选成份股,基金管理人将在严格控制跟踪误差的前提下,将结合使用其他合理方法进行适当替代。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

3、金融衍生品投资限制

本基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理,不得用于投机或放大交易,同时应当严格遵守下列规定:

(1)本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的100%;

(2)本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的10%;

(3)本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品,应当符合以下要求:

a. 所有参与交易的对手方(中资商业银行除外)应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级;

b. 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值,并且基金可在任何时候以公允价值终止交易;

c. 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的20%。

(4)基金管理人应当在本基金会计年度结束后60个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

4、本基金可以参与证券借贷交易,并且应当遵守下列规定:

(1)所有参与交易的对手方(中资商业银行除外)应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级;

(2)应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的102%;

(3)借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约,本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要;

(4)除中国证监会另有规定外,担保物可以是以下金融工具或品种:

a. 现金;

b. 存款证明;

c. 商业票据;

d. 政府债券;

e. 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构(作为交易对手方或其关联方的除外)出具的不可撤销信用证。

(5)本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券;

(6)基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

5、基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易,并且应当遵守下列规定:

(1)所有参与正回购交易的对手方(中资商业银行除外)应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级;

(2)参与正回购交易,应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已借出证券市值的102%。一旦买方违约,本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要;

(3)买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红;

(4)参与逆回购交易,应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的102%。一旦卖方违约,本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要;

(5)基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

6、基金参与证券借贷交易、正回购交易,所有已借出而未归还证券总市值或所有已借出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的50%。前项比例限制计算,基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

六、业绩比较基准

本基金业绩比较基准:经人民币汇率调整的恒生指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时,若变更业绩比较基准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业绩比较基准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体公告。若变更业绩比较基准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),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致后,报中国证监会备案并及时公告。

七、风险收益特征

本基金属于股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股,具有与标的指数大标的指数所表征的股票市场相似的风险收益特征,在股票基金中属于中等风险、中等收益的产品。

本基金为境外证券投资的基金,主要投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

此外,从投资者具体持有的基金份额来看,在分级运作期内,由于基金收益分配的安排,稳健收益类的恒生A份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征,其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额;积极收益类的恒生B份额则表现出高风险、高收益的显著特征,其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额。

八、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

投资组合报告

1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	122,190,637.84	87.71
	其中:普通股	122,190,637.84	87.71
	优先股	–	–
	存托凭证	–	–
	房地产信托凭证	–	–
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
	其中:远期	–	–
	期货	–	–
	期权	–	–
	权证	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	货币市场工具	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	9,731,588.27	6.99
8	其他资产	7,395,069.33	5.31
9	合计	139,317,295.44	100.00

1.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
香港	122,190,637.84	93.98
合计	122,190,637.84	93.98

1.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
001 能源	12,309,840.13	9.47
003 工业	5,716,329.54	4.40
004 非必需消费品	6,341,475.13	4.88
005 必需消费品	4,272,692.75	3.29
007 金融	67,470,920.93	51.89
008 信息技术	11,641,629.63	8.95
009 电信服务	8,531,828.25	6.56
010 公共事业	5,905,921.48	4.54
合计	122,190,637.84	93.98

1.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	HSBC Holdings plc	汇丰控股	5 HK	香港证券交易所	香港	284,400	17,743,360.50	13.65
2	Tencent Holdings Limited	腾讯	700 HK	香港证券交易所	香港	113,700	10,667,476.13	8.20
3	China Construction Bank Corporation	建设银行	939 HK	香港证券交易所	香港	1,714,000	7,972,456.75	6.13
4	AIA Group Limited	友邦保险	1299 HK	香港证券交易所	香港	245,400	7,586,924.44	5.84
5	China Mobile Limited	中国移动	941 HK	香港证券交易所	香港	123,500	7,371,715.00	5.67
6	Industrial And Commercial Bank Of China Limited	工商银行	1398 HK	香港证券交易所	香港	1,503,000	5,845,730.63	4.50
7	Bank of China Limited	中国银行	3988 HK	香港证券交易所	香港	1,619,000	4,459,231.94	3.43
8	CNOOC Limited	中国海洋石油	883 HK	香港证券交易所	香港	364,000	4,021,836.00	3.09
9	Hutchison Whampoa Limited	和记黄埔	13 HK	香港证券交易所	香港	43,000	3,617,912.50	2.78
10	PetroChina Company Limited	中国石油	857 HK	香港证券交易所	香港	430,000	3,341,449.38	2.57

1.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

注:本基金本报告期末未持有金融衍生品。

1.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注:本基金本报告期末未持有基金。

1.10 投资组合报告附注

1.10.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

1.10.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

1.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	5,699,511.87
3	应收股利	1,640,525.48
4	应收利息	1,986.42
5	应收申购款	970.18
6	其他应收款	–
7	待摊费用	52,075.38
8	其他	–
9	合计	7,395,069.33

1.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

1.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

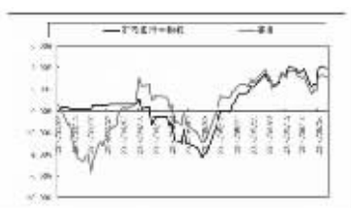
九、基金的业绩

本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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:

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)
2014年3月6日(基金合同生效日)至2014年6月30日	3.90%	0.59%	3.14%	0.78%	0.76%	-0.19%

2、自基金合同生效以来基金累计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图



十、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(含境外托管人收取的费用);

3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

5、基金份额持有人大会费用;

6、基金合同生效以后的信息披露费用。

7、基金的银行汇划费用;

8、基金收益分配中发生的费用。

9、基金进行外汇兑换交易的相关费用。

10、与基金缴纳税收有关的手续费、汇款费等。

11、其他为基金的利益而产生的费用,如代表基金投票产生的费用、与基金有关的诉讼费、追索费等。

12、基金依照有关法律法规应当缴纳的,购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税及预扣提税(以及与前述各项有关的任何利息及费用)(简称“税收”);

13、基金上市费用及年费;

14、标的指数的许可使用费;

15、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1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.20%÷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

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书,于次月前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、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书,于次月前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、公休日等,支付日期顺延。

3、基金的指数使用费

本基金作为指数基金,需要根据与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法计提指数使用费。指数使用费自基金首次挂牌之日起累计,计算方法如下:

H=E×0.04%÷当年天数

H为每日应计提的指数使用费

E为前一日的基金资产净值

若一个会计年度累计计提指数使用费金额小于指数使用许可协议规定的费用下限,则基金于年末最后一日补提指数使用费至指数使用许可协议规定的费用下限。

指数使用费每日计提,按季支付。经基金管理人和基金托管人核对一致后,基金托管人于次季度首日起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使用许可协议所规定的方式支付给标的指数许可方。

如果指数使用费的计算方法和费率等发生调整,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《信息披露管理办法》的规定在指定媒体进行公告。

上述“一、基金费用的种类中第3-15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因为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)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日按照《信息披露办法》的规定在指定媒体上刊登公告。

(五)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十一、基金管理人

一、基金管理人简况

名称:汇添富基金管理股份有限公司

住所:上海市黄浦区大沽路288号6幢538室

办公地址:上海市富城路99号震旦国际大楼22楼

法定代表人:林利军

成立时间:2005年2月3日

批准设立机关:中国证券监督管理委员会

批准设立文号:证监基金字[2005]5号

注册资本:人民币1亿元

联系人:李文

联系电话:(021)28932888

股东名称及其出资比例:

东方证券股份有限公司	47%
文汇新民联合报业集团	26.5%
东航金控有限责任公司	26.5%

二、主要人员情况

(一)董事会成员

潘鑫军先生,董事长。国籍:中国,1961年出生,澳门科技大学工商管理硕士。现任东方证券股份有限公司党委书记、董事长。历任中国工商银行股份有限公司上海分行长宁支行党委书记、行长兼国际机场支行党支部书记,东方证券股份有限公司党委副书记、总裁;党委书记、董事长兼总裁。

肖顺喜先生,董事,国籍:中国,1963年出生,复旦大学EMBA。现任东航金控有限责任公司总经理、东航集团财务有限责任公司董事长、东航国际控股(香港)有限公司董事长。历任东航期货公司总经理助理、副总经理、总经理、东航集团财务有限责任公司常务副总经理等。

陈保平先生,董事。国籍:中国,1953年出生。华东师范大学中国语言文学专业学士,南洋交大EMBA,高级编审。现任上海市市人大代表(教科文委员会专业委员)、市委宣传部新闻阅评督查组组长、上海市新闻工作者协会副主席,新民国际有限公司董事长、上海外滩画报传媒有限公司董事长、上海文汇新民进修学院董事长。历任文汇新民联合报业集团社长、党委副书记,新民晚报社总编辑、党委副书记,文汇新民联合报业集团副社长、文汇新民联合报业集团投资公司总经理、新民晚报社副总编辑、上海青年报社编辑、记者、部主任、副总编,上海三联书店总编辑、沪港三联副董事长、上海文艺出版总社党委书记、副社长、总编辑等。

林利军先生,董事,总经理。国籍:中国,1973年出生,美国哈佛大学商学院工商管理硕士,复旦大学世界经济系硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司总经理,汇添富资本管理有限公司董事长、总经理。历任上海证券交易所办公室主任助理、上市部总监助理,曾任职于中国证监会创业板筹备工作组,哈佛大学毕业后就职于美国道富金融集团(State Street Global Advisor)从事投资和风险管理工作。

韦杰夫(Jeffrey R. Williams)先生,独立董事。国籍:美国,1953年出生,哈佛大学商学院工商管理硕士,哈佛大学肯尼迪政府学院资深访问学者。历任美国花旗银行香港分行副总裁、深圳分行行长,美国运通银行台湾分行副总裁,台湾美国运通国际股份有限公司副总裁,渣打银行台湾分行总裁,深圳发展银行行长,哈佛上海中心董事总经理。

蔡来兴先生,独立董事,国籍:中国,1942年出生,上海同济大学学士。现任国务院参事室特约研究员,中国国学中心顾问。曾任上海市委、市政府副秘书长,香港上海实业集团董事长,香港上海实业控股有限公司董事长。第九、十、十一届全国政协委员,经济委员会委员。

杨燕青女士,独立董事,国籍:中国,1971年出生,复旦大学经济学博士。现任《第一财经日报》副总编辑,中欧陆家嘴国际金融研究院特邀研究员,《第一财经日报》创刊编委之一,第一财经频道高端对话节目《经济学人》栏目创始人和主持人,《波士堡》栏目资深评论员。曾任《解放日报》主任记者,《第一财经日报》编委,2002-2003年期间受邀成为约翰·霍普金斯大学访问学者。

(二)监事会成员

涂股廉先生,监事长。国籍:中国,1970年1月出生,上海财经大学硕士研究生。现任东航金控有限责任公司总经理助理审计发中心总经理。曾任职于中国东方航空公司总经理办公室,历任东航期货经纪有限责任公司部门经理、副总经理,东航金控有限责任公司投资管理部经理。

任瑞良先生,监事。国籍:中国,1963年出生,大学学历,中国注册会计师。现任文汇新民联合报业集团投资公司副总经理。历任文汇新民联合报业集团财务中心财务主管,文汇新民联合报业集团投资公司财务主管、总经理助理等。

李进安先生,监事。国籍:中国,1968年出生,金融学博士,中国注册会计师、律师资格。现任东方证券股份有限公司合规总监,上海东方证券资产管理有限公司合规总监。历任君安证券南京证券部总经理,国泰君安证券股份有限公司江苏区总协调人,国泰君安证券股份有限公司南京太平南路营业部总经理,总裁办公室、BPR办公室常务副主任,东吴证券有限责任公司总规划师、副总裁等职。

王静女士,职工监事,国籍:中国,1977年出生,中加商学院工商管理硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司综合办公室总监。曾任职于中国东方航空集团公司宣传部,东航金控有限责任公司研究发展部。

林璇女士,职工监事,国籍:中国,1977年出生,华东政法学院法学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司稽核监察部高级经理,汇添富资本管理有限公司监事。曾任职于东方证券股份有限公司合办公室。

陈杰先生,职工监事,国籍:中国,1979年出生,北京大学理学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司综合办公室高级经理。曾任职于罗兰贝格管理咨询有限公司,泰科电子(上海)有限公司能源事业部。

(三)高管人员

潘鑫军先生,董事长。(简历请参见上述董事会成员介绍)

林利军先生,总经理。(简历请参见上述董事会成员介绍)

李文先生,督察长。国籍:中国,1967年出生,厦门大学管理学博士,高级经济师,中国注册会计师。历任中国人民银行厦门市分行稽核监督处科员,中国人民银行杏林支行副行长,中国人民银行厦门中心支行银行管理处处长助理、金融机构监管二处副处长,东方证券股份有限公司稽核总部总经理,资金财务管理总部总经理等。现任汇添富基金管理股份有限公司督察长,汇添富资本管理有限公司董事。

张晖先生,副总经理。国籍:中国,1971年出生,经济学硕士,历任申银万国研究所高级分析师,富国基金管理有限公司高级分析师、研究主管和基金经理。2006年4月加盟汇添富基金管理股份有限公司,现任公司副总经理,投资决策委员会副主席。

陈灿辉先生,副总经理。国籍:中国,1967年出生,大学本科,历任中国银行软件开发工程师,招银电脑有限公司证券基金事业部负责人,华夏基金管理有限公司资深高级经理,招商基金管理有限公司信息技术部总监、总经理助理。2008年7月加盟汇添富基金管理股份有限公司,现任公司副总经理、首席营运官。

雷继明先生,副总经理。国籍:中国,1971年出生,工商管理硕士。历任中国民族国际信托投资公司网上交易部副总经理,中国民族证券有限责任公司营业部总经理、经纪业务总监、总裁助理。2011年12月加盟汇添富基金管理股份有限公司,现任公司副总经理。

娄焱女士,副总经理。国籍:中国,1971年出生,金融经济学硕士。曾在赛格国际信托投资股份有限公司、华夏证券股份有限公司、嘉实基金管理有限公司、招商基金管理有限公司、华夏基金管理有限公司以及富达基金北京与上海代表处工作,负责投资银行、证券投资研究,以及基金产品策划、机构理财等管理工作。2011年4月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任公司副总经理。

(四)基金经理

1、现任基金经理

赖中立先生,国籍:中国,1983年出生,北京大学中国经济研究中心金融学硕士,7年证券从业经验。曾任泰达宏利基金管理有限公司风险管理分析师。2010年8月加入汇添富基金管理股份有限公司任金融工程部分析师。2012年2月15日至今任汇添富上证综合指数基金、深证300交易型开放式指数证券投资基金、汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理,2012年11月1日至今任汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)的基金经理。2014年3月6日至今任汇添富恒生指数分级(QDII)基金的基金经理。

(五)投资决策委员会

主席:林利军先生(总经理)

副主席:张晖先生(副总经理)

成员:韩贤旺先生(研究总监)

(六)上述人员之间不存在近亲属关系。

十二、基金托管人

(一)基金托管人情况

1、基本情况

名称:中国农业银行股份有限公司(简称中国农业银行)

住所:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人:蒋超良

成立日期:2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银监复【2009】13号

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]23号

注册资本:32,479,411万元人民币

存续期间:持续经营

联系电话:010-68121510

传真:010-68121816

联系人:李芳菲

中国农业银