

# 华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金招募说明书 (更新) 摘要

2015年第2号

**基金管理人:华夏基金管理有限公司**  
**基金托管人:中国农业银行股份有限公司**

**重要提示**  
华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会2014年12月3日证监许可[2014]1303号文注册募集。本基金基金合同于2014年12月23日正式生效。基金管理人保证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。

本基金跟踪香港股票市场指数,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。本基金投资中的风险包括:因政治、经济、社会等环境因素对标的资产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;本基金的特有风险等。本基金是股票基金,风险高于货币市场基金、债券基金和混合基金。

本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股,基金优先通过港股通投资标的指数的成份股、备选成份股,未来如果出现由于沪港通额度受限、业务规则发生重大变更等影响投资运作的情形时,为了更好地保护投资人利益,实现投资目标,本基金将可以直接委托香港的经纪商投资标的指数的成份股、备选成份股。

在目前的结算规则下,T+1申购的基金份额在T+1日可以卖出或赎回。投资者认购本基金时需具有上海证券账户,上海证券账户是指上海证券交易场所A股账户或上海证券交易场所证券投资基金账户,但需注意:使用基金账户只能参与本基金的钱现交易和二级市场交易,如投资者需要参与基金的申购、赎回,则应使用A股账户。

投资有风险,投资者在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同,全面了解本基金的风险收益特征及产品特性,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。基金的历史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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。  
本招募根据本基金的基金合同和招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应仔细阅读基金合同。  
本招募说明书所载内容截止日为2015年12月23日,有关财务数据和净值表现数据截止日为2015年9月30日。(本招募说明书中的财务资料未经审计)

## 一、基金管理人

(一)基金管理人概况  
名称:华夏基金管理有限公司  
住所:北京市顺义区天竺空港工业区A区  
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座12层  
设立日期:1998年4月9日  
法定代表人:杨明辉  
联系人:张静  
客户服务电话:400-818-6666  
传真:010-63136700  
华夏基金管理有限公司注册资本为23800万元,公司股权结构如下:

持股单位	持股占总股本比例
中信证券股份有限公司	62.2%
山东省农村经济开发投资公司	10%
POWER CORPORATION OF CANADA	10%
青岛海融科技投资有限公司	10%
南方工业资产管理有限责任公司	7.8%
合计	100%

(二)主要人员情况  
1.基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况  
杨明辉先生:董事长,党委书记,中信证券股份有限公司执行董事,党委书记,硕士,高级经济师。兼任华夏基金管理有限公司董事长。曾任中信证券公司董事、襄理、副总经理,中信信托公司董事、常务副总裁,中国建设银行证券有限责任公司党委副书记,执行董事、总裁,兼任信诚基金管理有限公司董事长等。

杨一夫先生:董事,硕士。现任鲍尔太平有限公司总裁,负责总部加拿大鲍尔公司在中国的投资活动,兼任中信能源开发有限公司董事,中国投资协会常务理事。曾任国际货币基金组织(世界银行组织成员)驻中国的首席代表等。

胡祖六先生:董事,博士,教授。现任春华资本集团主席,曾任国际货币基金组织高级经济学家,达沃斯世界经济论坛首席经济学家,高盛集团大中华区主席、合伙人、董事总经理。

徐刚先生:董事,博士。现任中信证券执行委员会委员、董事总经理,经纪业务发展与管理委员会主任、战略规划部行政负责人,亦担任中信证券(山东)有限责任公司、中信期货有限公司、前海股权交易中心(深圳)有限公司、青岛蓝海股权交易中心有限责任公司、厦门两岸股权交易中心有限公司、证通股份有限公司等公司董事。

葛小波先生:董事,硕士。现任中信证券执行委员会委员、董事总经理,全球首席财务官,财务负责人,亦担任金石投资有限公司、中信证券投资有限公司等公司董事,中信证券上海自贸试验区分公司负责人。葛先生于2007年荣获全国金融五一劳动奖章。

汤晓晖先生:董事,总经理,硕士。兼任华夏资本管理有限公司董事,上海华夏财富投资管理有限公司董事长。曾任任职于摩根大通、荷兰银行、苏格兰皇家银行、中国证监会等。

朱武祥先生:独立董事,博士,教授。现任清华大学经济管理学院金融系教授,博士生导师,兼任北京建设(香港上市)、华夏幸福基金、中海油海洋工程、荣信股份、东证证券等多家上市公司独立董事。

贾建平先生:独立董事,大学本科学历,高级经济师。曾退休、兼任东莞银行独立董事。曾任任职于北京工艺品进出口公司、美国纽约中创地产有限公司(外派工作),曾任中国银行信托咨询公司副董事长、处长,中国银行资产托管部副总经理,中国银行意大利代表处首席代表,中银集团投资管理有限公司副董事长、总经理,中国银行重组上市办公室、董事会秘书办公室、上市办公室主任,中银基金管理有限公司董事长。

谢德仁先生:独立董事,博士,教授。现任清华大学经济管理学院会计学教授、博士生导师,兼任同方环境股份有限公司、博彦科技股份有限公司(上市公司)、朗新科技股份有限公司独立董事,中国会计学会第八届理事常务理事,中国会计学会财务成本分会第八届理事分会副会长。

张霄岭先生:副总经理,博士。现兼任上海高级金融学院客座教授、清华大学五道口金融学院特聘教授。曾任中国技术进出口总公司项目经理、美国联储储备委员会(华盛顿总部)经济学家、摩根士丹利(纽约总部)信用衍生品交易模型风险主管、中国证监会监管银行监管三部副主任等。

刘义先生:副总经理,硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员,曾任中国人民银行总行计划资金司副主任科员、主任科员,中国农业发展银行总行信息电脑部综合处副处长(主持工作)、华夏基金管理有限公司监事、党办主任、养老金业务总监等。

阳琨先生:副总经理、投资总监,硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员。曾任中国对外经济贸易信托投资有限公司财务部副经理,宝盈基金管理有限公司基金助理助理,晨星基金管理有限公司投资管理部副经理,华夏基金管理有限公司股票投资部副经理等。

李一梅女士:副总经理,硕士。兼任上海华夏财富投资管理有限公司总经理。曾任基金营销部总经理、营销总部、市场总监等。

孙毅先生:副总经理,硕士。现任华夏资本管理有限公司董事、总经理。兼任上海华夏财富投资管理有限公司董事。曾任中国南方证券有限责任公司投资银行部项目经理,国信证券股份有限公司投资银行部高级经理,中信证券股份有限公司投资银行部副总经理,中信证券(香港)有限公司企业融资业务董事总经理,中信证券股份有限公司投资银行部执行总经理、董事总经理(担任行政委运营部、资本市场部、交通银行组行政负责人)等。

周晓女士:督察长,硕士。现任华夏基金管理有限公司纪委书记。曾任华夏基金管理有限公司总经理助理,曾任任职于中国证监会、北京金融街建设开发公司。

李红源先生:监事长,硕士,研究员级高级工程师。现任南方工业资产管理有限责任公司总经理。曾任中国北方光学电子总公司信息部职员,中国兵器工业总公司教育局职员、主任科员、规划处副处长、计划处长,中国兵器装备集团公司发展计划部副主任、经济运营部副主任,资本运营部巡视员兼副主任。

吕刚先生:监事,学士。现任中信证券股份有限公司投资管理部执行总经理,曾任国家劳动部综合计划与工资司副主任科员,中信证券股份有限公司人力资源部管理行政行总经理。  
张伟先生:监事,硕士,高级工程师。现任山东高速投资控股有限公司党委书记、副总经理,兼任山东渤海轮渡股份有限公司董事、高级管理人员、财务建设指挥部办公室财务科科员,青岛高速公物管理局经营财务处副主任科员,山东基建股份有限公司计划财务部经理,山东高速股份有限公司董事、党委委员、总会计师。

任贤女士:监事,博士。现任华夏基金管理有限公司董事总经理。曾任财政部科研所助理研究员,中关村证券股份有限公司计划资金部总经理,华夏基金管理有限公司财务总监等。

李彬女士:监事,硕士。现任华夏基金管理有限公司法律监察部总监。曾任中信证券股份有限公司基金管理部项目经理,中信基金管理有限责任公司监察稽核部高级副总裁,华夏基金管理有限公司法律监察部副经理等。

尹强先生:监事,博士,高级编辑。现任华夏基金管理有限公司办公室总监、董事会秘书(兼)。曾任中国证券报社记者、编辑,办公室主任、副总编辑,中国政法大学讲师。

2.本基金基金经理  
王路先生,博士。曾任美国纽约德意志资产管理公司基金经理及定量策略研究负责人,美国纽约兴银银行组合经理,大成基金国际业务部副总监等。2008年11月加入华夏基金管理有限公司,曾任数量投资部总经理等,现任数量投资部执行总经理、首席量化投资官,恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2012年8月9日起任职),恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2013年2月28日起任职),上证原材料交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2013年3月28日起任职),上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2013年3月28日起任职),华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2014年12月23日起任职),华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2015年1月13日起任职),华夏沪深300指数增强型证券投资基金基金经理(2015年2月10日起)。

张弘毅先生,硕士。2000年4月加入华夏基金管理有限公司,曾任研究发展部总经理、数量投资部副经理等,现任数量投资部执行总经理,华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2009年7月10日起任职),恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2012年8月9日起任职),恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2012年8月21日起任职),华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2012年12月25日起任职),上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2013年3月28日起任职),上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2013年3月28日起任职),华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2014年12月23日起任职),华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2015年1月13日起任职),MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2015年2月12日起任职)。

徐慧女士,清华大学工学硕士。曾任财富证券助理研究员,原中关村证券研究员等。2006年2月加入华夏基金管理有限公司,曾任数量投资部基金助理助理等,现任数量投资部高级副总监,上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2013年4月8日起任职),华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2015年3月12日起任职),华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2015年3月12日起任职),恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2015年12月21日起任职),恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2015年12月21日起任职),上证原材料交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2016年1月29日起任职)。

3.本公司授权投资决策委员会主任:王路先生,华夏基金管理有限公司数量投资部执行总经理、首席量化投资官,基金经理。  
成员:汤晓晖先生,华夏基金管理有限公司董事、总经理。  
张弘毅先生,华夏基金管理有限公司数量投资部执行总经理,基金经理。  
方军先生,华夏基金管理有限公司数量投资部总监,基金经理。  
杨志诚先生,华夏基金管理有限公司数量投资部总监。  
4.上述人员之间不存在亲属关系。

## 二、基金托管人

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:刘士余  
成立日期:2009年1月16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:32,479,411.7万元人民币  
存续期间:持续经营  
联系电话:010-66000699

传真:010-68121816  
联系人:林嵩

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立,中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广、服务领域最广、服务对象最多、业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造“伴你成长”服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004年被英国《全球财资》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计,并获得无保留意见的SAS70审计报告,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届“‘金理财’TOP10颁奖盛典”中成绩突出,获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2004年9月更名为托管业务部,内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

(三)主要人员情况  
中国农业银行托管业务部现有员工140余人,其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余人,客户服务团队专业水准高、业务素质很好,服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

(三)基金托管业务经营情况  
截止到目前为止2015年12月31日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共321只。

## 三、相关服务机构

(一)基金份额销售机构  
1.申购赎回代理机构  
(1)国泰君安证券股份有限公司  
住所:上海市浦东新区商城路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  
法定代表人:万建华  
电话:021-38676161  
传真:021-38670161  
联系人:芮银祺  
网址:www.gtja.com  
客户服务电话:400-888-8666  
(2)中信建投证券股份有限公司  
住所: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  
法定代表人:王常青  
客户服务电话:400-888-8108  
传真:010-65182621  
联系人:权辉  
网址:www.csc.com.cn  
(3)国信证券股份有限公司  
住所: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  
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  
电话:0755-82130833  
传真:0755-82130852  
联系人:周杨  
网址:www.guosen.com.cn  
(4)招商证券股份有限公司  
住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座39-45层  
办公地址:深圳福田区益田路江苏大厦A座40层  
法定代表人:宫少林  
电话:0755-82943666  
传真:0755-82943636  
联系人:黄健  
网址:www.newone.com.cn  
(5)广发证券股份有限公司  
住所:广州天河区天河东路183-187号广东会堂广场43楼(4301-4316房)  
办公地址:广州市天河区天河北路188-189号大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼  
法定代表人:孙树树  
电话:020-87556888  
传真:020-87554177  
联系人:黄真  
网址:www.gf.com.cn  
客户服务电话:95675或致电各地营业网点  
(6)中信证券股份有限公司  
住所:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第4层  
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:王东明  
电话:010-60833722  
传真:010-60833729  
联系人:陈忠  
网址:www.cs.ecitic.com  
(7)中国银河证券股份有限公司  
住所:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层  
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层  
法定代表人:朱启华  
联系电话:010-57673888  
传真:010-57677777  
联系人:李静  
经办律师:吴冠雄、李颖

(四)律师事务所  
名称:中国法律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:陈文祥  
电话:021-68419096  
传真:021-68870311  
(三)律师事务所  
名称:北京市天元律师事务所  
住所:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层  
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层  
法定代表人:朱小华  
联系电话:010-57673888  
传真:010-57677777  
经办人:李静  
经办律师:吴冠雄、李颖

(四)会计师事务所  
名称:德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所:上海市延安东路222号30楼  
办公地址:中国北京东长安街1号东方广场东塔楼德勤大厦8楼  
法定代表人:卢许临  
联系电话:010-58307788  
传真:010-58182128  
联系人:吕舒

四、基金的名称  
五、基金的类型  
本基金名称:华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金。  
六、基金的投资目标  
本基金主要投资于跟踪标的指数的成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标,本基金还可投资于全球市场的债券、基金、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,基金投资标的指数的成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%。

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

八、基金的投资策略  
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策略,跟踪标的指数的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、因法律法规原因对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  
本基金投资股指期货主要遵循有效管理投资策略,主要采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对现货股指期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平,谨慎参与股指期货投资,力争取得超额投资收益,并承担相应的基金投资风险。  
本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.25%,年跟踪误差不得超过2%。

本基金优先通过港股通投资标的指数的成份股、备选成份股,未来如果出现由于沪港通额度受限、业务规则发生重大变更等影响投资运作的情形时,为了更好地保护投资人利益,实现投资目标,本基金将可以直接委托香港的经纪商投资标的指数的成份股、备选成份股,不需召开持有人大会。

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。

九、基金的业绩比较基准  
本基金业绩比较基准为经估值汇率调整的恒生指数的收益率。  
若基金的指数发生变更,基金业绩比较基准随之变更,基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据投资情况和市场惯例调整基金业绩比较基准的组成和权重,无需召开基金份额持有人大会,但基金管理人调整业绩比较基准取得基金托管人同意后,报中国证监会备案,基金管理人应在调整实施前按照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒介上予以公告。

十、基金的风险收益特征  
本基金属于股票基金,风险收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数的成份股及备选成份股,具有与标的指数相似的风险收益特征。  
本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市场基金类似的市场波动风险等一般投资风险外,本基金还面临汇率风险、香港市场流动性风险等特殊市场风险而面临的特别投资风险。

十一、基金的投资组合报告  
以下内容摘自本基金2015年第3季度报告:  
“5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	296,076,782.71	90.99
	其中:普通股	296,076,782.71	90.99
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	-	-
	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	银行存款和拆出资金	7,233,122.43	2.27
7	其他各项资产	1,963,383.89	0.64
9	合计	306,269,289.01	100.00

注:股票投资的公允价值包含自提替代估值增值。

网址:www.cindas.com  
客户服务电话:96321  
(16)光大证券股份有限公司  
住所:上海市静安区新闸路1508号  
办公地址:上海市静安区新闸路1508号  
法定代表人:薛峰  
电话:021-22169081  
传真:021-22169134  
联系人:刘晨

网址:www.abscn.com  
客户服务电话:96265,400-888-8788  
(17)东北证券股份有限公司  
住所:长春市自由大路1138号  
办公地址:长春市自由大路1138号  
法定代表人:李福春  
电话:0431-85096517  
传真:0431-85096706  
联系人:安岩吉  
网址:www.nesc.cn  
客户服务电话:96360  
(18)国联证券股份有限公司  
住所:无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦  
办公地址:深圳前海湖心路金融一街5号国联金融大厦  
法定代表人:姚志洪  
电话:0610-82921662  
传真:0610-82920162  
联系人:徐欣  
网址:www.glig.com.cn  
客户服务电话:96570

(19)国都证券股份有限公司  
住所:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层,10层  
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  
法定代表人:常喆  
电话:010-84183389  
传真:010-84183311-3389  
联系人:黄静  
网址:www.guodu.com  
客户服务电话:400-818-8118  
(20)中泰证券股份有限公司  
住所: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96号  
法定代表人:李玮  
电话:0631-68889156  
传真:0631-68889185  
联系人:吴阳  
网址:www.zts.com.cn  
客户服务电话:96538  
(21)华夏证券有限责任公司  
住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(1)单元  
办公地址:上海市徐汇区宛平南路8号  
法定代表人:俞洋  
电话:021-54067203  
传真:021-54067293  
联系人:王道  
网址:www.cfsc.com.cn  
客户服务电话:021-32109999,029-68918888,400-109-9918  
(22)中国中投证券有限责任公司  
住所: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层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元  
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层  
法定代表人:宫少林  
电话:0755-82024442  
传真:0755-82026539  
联系人:黄健  
网址:www.china-invs.cn  
客户服务电话:400-888-8008,95532  
二、二级市场交易代理券商  
包括具有经纪业务资格和上海证券交易会员资格的所有证券公司。

3.本基金管理人可以根据实际情况增加或者减少销售机构,并予以公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点。

(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:陈文祥  
电话:021-68419096  
传真:021-68870311  
(三)律师事务所  
名称:北京市天元律师事务所  
住所:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层  
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层  
法定代表人:朱小华  
联系电话:010-57673888  
传真:010-57677777  
经办人:李静  
经办律师:吴冠雄、李颖

(四)会计师事务所  
名称:德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所:上海市延安东路222号30楼  
办公地址:中国北京东长安街1号东方广场东塔楼德勤大厦8楼  
法定代表人:卢许临  
联系电话:010-58307788  
传真:010-58182128  
联系人:吕舒

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4 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  
金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称(中文)	证券代码	所在市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	H03C	HOLDINGS PLC	00006	香港	中国香港	724,800	34,273,080.89	11.26
2	TENENT	HOLDINGS LTD	00700	香港	中国香港	296,200	31,413,709.89	10.32
3	CHINA MOBILE	中国移动有限公司	00941	香港	中国香港	323,200	24,368,616.36	8.00
4	AIA GROUP LTD	友邦保险控股有限公司	01299	香港	中国香港	631,600	20,748,193.56	6.81
5	CHINA CONSTRUCTION BANK	中国建筑股份有限公司	00939	香港	中国香港	4,432,000	18,721,586.70	6.15
6	IND & COMMERCE OF CHINA	中国工商银行股份有限公司	01398	香港	中国香港	3,885,000	14,212,207.23	4.67
7	CK HUTCHINSON HOLDING LTD	长江实业集团有限公司	00001	香港	中国香港	141,764	11,661,164.39	3.83
8	BANK OF CHINA LTD	中国银行股份有限公司	03988	香港	中国香港	4,156,000	11,361,556.68	3.73
9	PING AN INSURANCE GROUP CO	中国平安保险(集团)股份有限公司	02318	香港	中国香港	274,000	6,618,894.82	2.83
10	CHINA LIFE INSURANCE COMPANY LTD	中国人寿保险股份有限公司	02628	香港	中国香港	390,000	6,573,043.96	2.82

注:所用证券代码采用当地市场代码。  
5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合  
本基金报告期末未持有债券。  
5.6 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  
本基金报告期末未持有债券。  
5.7 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  
本基金报告期末未持有资产支持证券。  
5.8 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  
本基金报告期末未持有金融衍生品。  
5.9 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  
本基金报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注  
5.10.1 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现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、处罚的情形。  
5.10.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票范围。  
5.10.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收券商清算款	-
3	应收股利	1,929,000.10
4	应收利息	-
5	其他应收款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	23,000.00
8	其他资产	-
9	合计	1,963,383.89

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。  
5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。  
5.10.6 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,分项之和与合计项之间可能存在尾差。”

十二、基金的业绩  
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。基金的历史业绩并不预示其未来表现。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。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列示。

期间	份额净值增长率①	份额净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率基准④	①-③	②-④
2014年12月23日至2014年12月31日	0.07%	0.01%	0.03%	1.05%	-0.56%	-1.04%
2015年1月1日至2015年3月31日	-10.74%	1.88%	-0.52%	1.43%	-1.22%	-0.06%

十三、费用概览  
(一)基金运作费用  
1.基金费用的种类  
(1)基金管理人的管理费。  
(2)基金托管人的托管费。  
(3)标的指数许可使用费(包括为指数公司缴纳的相关税收以及与支付外币相关的汇兑损益