

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

2016年第1号

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司

重要提示

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2012年6月14日证监许可[2012]922号文批准募集。本基金合同于2012年6月9日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书中内容真实、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,并不表示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,投资者根据所持有的基金份额享受基金收益,同时也承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括: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个别风险;由于基金份额持有人在连续大量赎回基金产生的流动性风险;本基金的特定风险等。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,在股票基金中属于中等风险,中等收益的产品。

本基金主要投资于香港证券市场的ETP,基金份额的销售及收入和公募ETP存在一定差异,通常情况下,ETP申购的基金份额在当日在卖方账户中,赎回的基金份额在买方账户中。投资者申购本基金时具有深圳证券账户,但需注意:使用基金账户只能参与本基金的现金申购和二级市场交易,如投资者需要参与基金的赎回,则必须使用A股账户。本基金以人民币募集和计价,经过换汇后主要投资于香港市场以港币计价的金融工具,人民币对港币的汇率波动可能加大基金净值的波动,从而对基金净值产生影响。

投资有风险,投资者在投资基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断后,谨慎做出投资决策。本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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本摘要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,其基金份额的行为本即表明其对基金合同的承认和接受,并按《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,应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2016年2月9日,有关财务数据和净值表现数据截止日为2015年12月31日。(本招募说明书中财务数据未经审计)

一、基金的名称

本基金名称:恒生交易型开放式指数证券投资基金。

二、基金的类型

本基金类型:交易型开放式。

三、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

四、基金的投资方向

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,本基金投资于标的(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、期权、权证等)、符合证监会规定的银行存款类货币市场工具以及中国证监会准许基金投资的其他金融工具。

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、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。

(一)组合复制策略

本基金主要采取复制策略,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。

(二)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额数量的投资时,基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股、成份股衍生品等方式进行替代。

(三)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,本基金将保留一定的现金头寸以满足赎回以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持有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。

本基金的申购赎回偏离度的绝对值不超过0.35%,跟踪误差不超过2%。

未来,随着投资工具的发展丰富,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,并在招募说明书中更新相关公告。

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标的指数收益率。其中,经人民币汇率调整的标的指数为人民币/港币汇率×恒生指数。

若基金的指数发生变化,本基金业绩比较基准将变更,基金管理人可根据投资情况和市场惯例调整基金业绩比较基准的构成和权重,无需召开基金份额持有人大会,但基金管理人应取得基金托管人同意后,报中国证监会备案。

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,在股票基金中属于中等风险,中等收益的产品。

本基金境外证券投资的基金,主要投资于香港证券市场,具有良好的流动性的金融工具。除了需要承担与境内证券投资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。

八、基金投资组合报告

以下内容摘自本基金2015年第4季度报告:

“5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权证投资	567,104,756.60	78.94
2	其中:普通股	567,104,756.60	78.94
3	衍生工具	-	-
4	固定收益投资	-	-
5	其中:债券	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	其他投资	-	-
9	期权	-	-
10	权证	-	-
11	买入返售金融资产	-	-
12	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
13	同业存放	-	-
14	银行存款和结算备付金合计	143,981,406.97	20.04
15	其他各项资产	7,369,630.46	1.02
16	负债	-	-
17	合计	718,444,796.02	100.00

注:①股票投资的公允价值包含可转债款的估值增值。

②本基金报告期末通过沪港通机制投资香港股票的公允价值为20,743.43元,占基金资产净值比例为0.00%。

5.2 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

金额单位:人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
中国香港	667,081,560.04	82.64
合计	667,081,560.04	82.64

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
金融	326,290,813.04	47.55
信息技术	71,338,450.29	10.40
能源	33,423,847.66	4.87
电信服务	41,405,113.69	6.62
公用事业	27,913,800.69	4.07
工业	31,546,338.04	5.33
非必需消费品	14,220,009.26	2.07
必需消费品	11,942,777.40	1.74
材料	-	-
保健	-	-
合计	667,081,560.04	82.64

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	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所持股票(或基金)数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	TELECENT HOLDINGS LIMITED	腾讯控股有限公司	00700	香港	523,543	66,888,612.82	9.76
2	HBC HOLDING	汇丰控股有限公司	00006	香港	1,282	66,498,052.26	9.69
3	AIA GROUP LIMITED	友邦保险有限公司	01299	香港	1,096	42,817,201.57	6.24
4	CHINA MOBILE LIMITED	中国移动有限公司	00941	香港	664,018	41,946,542.59	6.03
5	CHINA CONSTRUCTION CORPORATION	中国建设银行股份有限公司	00039	香港	7,708	34,692,859.46	5.06
6	INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA LIMITED	中国工商银行股份有限公司	01398	香港	6,708	26,302,489.95	3.83
7	CK HUTCHISON HOLDING LIMITED	长和集团有限公司	00001	香港	268,608	23,543,857.22	3.43
8	BANK OF CHINA LIMITED	中国银行股份有限公司	03988	香港	7,351,991	21,311,394.53	3.11
9	HONG KONG EXCHANGES & CLEARANCES LIMITED	香港交易所及结算有限公司	00388	香港	106,201	17,661,156.15	2.57
10	PING AN INSURANCE GROUP OF CHINA LIMITED	中国平安保险(集团)股份有限公司	02318	香港	463,811	16,708,577.92	2.44

注:所用证券代码采用当地市场代码。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资组合

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。

金额单位:人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	股权质押	HANG SENG IDX PUT_Jun16	-	-
2	-	-	-	-
3	-	-	-	-
4	-	-	-	-
5	-	-	-	-

注:期货投资采用当日无负债结算制度,相关价值已包含在结算备付金中,具体投资情况详见下表

(买入持仓量以正数表示,卖出持仓量以负数表示):

金额单位:人民币元

代码	名称	持仓量(元/类)(单位:手)	合约市值	公允价值变动
HIP6	HANG SENG IDX PUT_Jun16	104	94,630,951.28	1,526,525.07
公允价值变动总额合计	-	-	-	1,526,525.07
股指期货投资本期收益	-	-	273,084.14	-
股指期货投资本期公允价值变动	-	-	-	4,736,601.99

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