

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

2017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]303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。

本基金跟踪香港市场股票指数,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、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、汇率风险、基金份额持有人的股票、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;本基金的特定风险等。本基金是股票型基金,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,基金优先通过港股投资标的指数的成份股,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价值的情形时,为了更好地保护投资者利益,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日申购的基金份额在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,上海证券账户只能通过证券交易所A股账户或上海证券交易所以外证券基金账户,但需注意:使用基金账户只能参与本基金的现金认购二级市场申购,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,理性判断市场,谨慎做出投资决策。

基金的投资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。基金投资者依据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承认基金合同的承认和授权,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,应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2017年6月23日,有关财务数据和净值表现数据截止日为2017年3月31日。(本招募说明书中的财务数据未经审计)

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8层
设立日期:1988年4月9日
法定代表人:杨明辉
联系人:李彬
客户服务电话:400-918-6666
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%
青岛海鹏投资管理有限公司	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、总经理,硕士,高级经济师。曾任中信证券股份有限公司、襄理、副总经理,中信控股公司董事、常务副总裁,中国建设银行董事、襄理,中国证监会办公厅、执行董事、总裁,兼任信诚基金管理有限公司董事长、证通股份有限公司董事等。

杨一天先生:董事,硕士。现任海尔太平洋有限公司总裁,负责总部加拿大海尔公司在中国的投资活动,兼任三川能源开发有限公司董事、中国投资协会常务理事。曾任国际金融中心(世界银行组织成员)驻中国首席代表等。

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。

沈强先生:董事,硕士,高级经济师。现任中信证券股份有限公司经纪业务发展与管理委员会主任。曾任浙江省国际信托投资公司证券管理总部总经理,金通证券股份有限公司总经理,中信证券(浙江)有限责任公司总经理,党委书记、执行董事,中信证券股份有限公司经纪业务发展与管理委员会副主任等。

王小波先生:董事,硕士,中信证券党委委员、董事总经理,葛兰生于2007年荣获全国金融五一劳动奖章。

汤晓波先生:董事、总经理、教授。曾任职员摩根大通、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)、华夏幸福基业、中海海洋工程、东兴证券、中兴通讯等五家上市公司独立董事。

贾建军先生:独立董事,大学本科,高级经济师,现已退休。兼任东莞银行独立董事。曾任职员于北京工艺品进出口公司、美国纽约中国有限公司(外派工作),曾担任中国银行信托投资公司副处长、处长,中国银行卢森堡公司副总经理,中国银行光大代表处首席代表,中银集团投资管理公司副董事长、总经理,中国银行银行组上市办公室、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,兼任中华联合人寿保险股份有限公司、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会理事,中国会计学会财务成本分会第八届理事会副会长。

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、美国联邦储备委员会(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管理主管,中国证监会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部副主任科员、主任科员,中国农业银行总行总信息电脑部信息综合处副处长(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,华夏基金管理有限公司执行董事、总经理等。

阳璟先生: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(经理),宝盈基金管理有限公司基金经理助理,益民基金管理有限公司投资部部门经理,华夏基金管理有限公司股票投资部副总经理等。

李一梅女士:副总经理,硕士。兼任证通股份有限公司董事。曾任基金营销部总经理、营销总监、市场总监,上海华夏财富投资管理有限公司执行董事、总经理等。

周璇女士: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经理,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。

闫莉女士: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部执行总经理。

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,兼任山东渤海湾疏浚股份有限公司董事。曾任山东省济青公路工程建设指挥部办公室财务科职员,济青高速公路管理局经营财务处主任科员,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。

汪晖女士:监事,博士。现任华夏基金管理有限公司党委委员。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财务部总经理,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合规部执行总经理、信息披露负责人。曾任中信证券股份有限公司基金管理部项目经理、中信基金管理有限公司监察稽核部高级副总监、华夏基金管理有限公司法律监察部总监等。

宁晨新先生: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
张弘迈先生,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、数量投资部副总经理,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日至2016年3月28日期间)等,现任数量投资部董事总经理,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联接基金基金经理(2015年2月12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)、华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2016年11月2日起任职)、上证50交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2016年11月18日起任职)、华夏鼎融债券型证券投资基金基金经理(2016年12月29日起任职)、华夏睿泰盛六个月定期开放混合型证券投资基金(2017年3月15日起任职)。

徐猛先生,清华大学工学硕士。曾任财富证券助理研究员,原中关村证券数量研究员等。2006年2月加入华夏基金管理有限公司,曾任数量基金基金经理助理,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日至2016年3月28日期间)等,现任数量基金部总监,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联接基金基金经理(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)、中大创业板交易型开放式指数基金基金经理(2016年12月1日起任职)、华夏上证50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2016年12月1日起任职)。

历任基金经理:2014年12月23日至2017年2月10日期间,王路先生任本基金经理。

3.本公司量化投资决策委员会
主任:张弘迈先生,华夏基金管理有限公司董事总经理,基金经理。成员:汤晓波先生,华夏基金管理有限公司董事、总经理。徐猛先生,华夏基金管理有限公司数量投资部总监,基金经理。宋洋女士,华夏基金管理有限公司数量投资部总监,基金经理。

4.上述人员之间不存在近亲属关系。

(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:周慕冰
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:32,479,411.7万元人民币
存续期间:持续经营
联系电话:010-66060609
传真:010-68121816

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,着力打造了“伴您成长”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首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年被评为美国《全球托管人》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,并获无保留意见的SAS70审计报告。自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内部控制标准(ISA3402)认证,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“金牌理财”TOP10颁奖盛典中,连续获得“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”。2013年至2015年连续获得中国债券市场“优秀托管机构”奖,2015年由中国银行间市场协会授予“养老金业务最佳实践奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年6月在中国证监会和中国人民银行批准成立,2014年更名为托管业务部/养老金管理中心,内设综合管理处、证券投资基金托管处、委托资产托管处、境外资产托管处、保险资产托管处、风险管理处、技术保障处、数据中心、市场营销处、内控监督处、稽核管理处,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2.主要人员情况
中国农业银行托管业务部现有员工140余人,其中具有高级职称的专职30余人,服务团队成员专业水平高、业务素质好、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。

3.基金托管业务经营情况
截止至2016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349只。

(二)基金托管人的内部控制制度说明
1.内部控制目标
严格遵守国家有关托管业务的法律法规,行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作,严格监督,确保基金财产的完整、安全,确保基金托管人安全完整,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。

2.内部控制组织结构
风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理及内部控制工作进行监督评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

3.内部控制制度及措施
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;业务管理实行严格的复核、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;业务操作程序专门设置,封闭运行,实施录像操作;业务信息通过专信信息系统披露,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
基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议约定的投资比例和投资品种纳入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式处理:

1.电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人; 2.书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等情况,以书面形式对基金管理人进行提示; 3.书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报告中国证监会。

三、相关服务机构

(一)申购赎回代理机构
1.申银万国证券股份有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区商城路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:陈共石
电话:021-38676161
传真:021-38670161

联系人:芮敬祺
网址:www.guodu.com
客户服务电话:400-918-8118

(2)中泰证券股份有限公司
住所:山东省济南市经二路73号
办公地址:山东省济南市经二路纬六路86号
法定代表人:李玮
电话:0631-68889155
传真:0631-68889185

联系人:王紫霄
网址:www.zts.com.cn
客户服务电话:95538

(21)华鑫证券有限责任公司
住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(1)B(1)单元
办公地址:上海市徐汇区肇嘉浜路750号
法定代表人:俞涛
电话:021-54067562
传真:021-54067032

联系人:杨莉娟
网址:www.xcsc.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01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.22.23.25层
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:高涛
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539

联系人:高涛
网址:www.china-invs.com
客户服务电话:400-600-8008、953632

联系人:黄健
网址:www.newone.com.cn
客户服务电话:95665

(5)广发证券股份有限公司
住所:广州天河区天河北路183-187号万都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址:广州天河区天河北路183-187号万都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人:孙树明
电话:020-87556888
传真:020-87555417

联系人:黄岚
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益田路4088号招商银行大厦A层18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:王明
电话:010-60833722
传真:010-60833739

联系人:陈忠
网址:www.cs.ecitic.com
客户服务电话:95548

(7)中国银河证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街36号2-6层
办公地址:北京市西城区月坛南街1号院9号
法定代表人:陈共石
电话:010-66563420
传真:010-66568990

联系人:田薇
网址:www.chinastock.com.cn
客户服务电话:4008-889-888或95551

(8)海通证券股份有限公司
住所:上海市淮海中路98号
办公地址:上海黄浦区广东路689号10楼
法定代表人:王开国
电话:021-23219000
传真:021-63410466

联系人:金奈、李笑鸣
网址:www.htsc.com
客户服务电话:95553、400-888-8001

(9)申万宏源证券有限公司
住所:新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址:北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人:李梅
客户服务电话:400-800-0562
传真:010-89086559

联系人:钱彦刚
网址:www.hysec.com
(10)长江证券股份有限公司
住所:武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡皓军
电话:027-65799999
传真:027-85481900

联系人:李民
网址:www.95579.com
客户服务电话:95579、400-888-8999

(11)安信证券股份有限公司
住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
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
法定代表人:牛冠兴
电话:0755-82568305
传真:0755-82568355

联系人:陈剑虹
网址:www.essence.com.cn
客户服务电话:400-800-1001

(12)西南证券股份有限公司
住所:重庆市北区桥北苑8号
办公地址:重庆江北区桥北苑2号西南证券大厦
法定代表人:吴坚
电话:023-67676411
传真:023-67676212

联系人:张煜
网址:www.swsc.com.cn
客户服务电话:400-809-6006

(13)湘财证券股份有限公司
住所:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新城商务中心C栋11楼
办公地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新城商务中心A栋11楼
法定代表人:林俊波
电话:021-68634510-8620
传真:021-68866680

联系人:赵小明
网址:www.xcsc.com
客户服务电话:400-888-1551

(14)中信证券(山东)有限责任公司
住所:山东省青岛市市南区深圳路222号1号楼2001
办公地址:山东省青岛市市南区深圳路222号1号楼2001
法定代表人:杨宝林
电话:0632-83472266
传真:0632-83022305

联系人:吴忠超
网址:www.citicsd.com
客户服务电话:95548

(15)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
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
电话:010-63081000
传真:010-63080978

联系人:尹迪航
网址:www.cindasc.com
客户服务电话:95321

(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.ebscn.com
客户服务电话:95525、400-888-8788

(17)东方证券股份有限公司
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:0431-80906517
传真:0431-80906795

联系人:安岩岩
网址:www.nesc.cn
客户服务电话:95360

(18)国联证券股份有限公司
住所:无锡市太湖新城金融一街9号国联金融大厦
办公地址:无锡市太湖新城金融一街9号国联金融大厦
法定代表人:裘志刚
电话:0510-82831662
传真:0510-82830162

联系人:徐欣
网址:www.glsc.com.cn
客户服务电话:95570

(19)国泰证券股份有限公司
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:常浩
电话:010-84183831
传真:010-84183311-3389

联系人:黄静
网址:www.guodu.com
客户服务电话:400-918-8118

(20)中泰证券股份有限公司
住所:山东省济南市经二路73号
办公地址:山东省济南市经二路纬六路86号
法定代表人:李玮
电话:0631-68889155
传真:0631-68889185

联系人:王紫霄
网址:www.zts.com.cn
客户服务电话:95538

(21)华鑫证券有限责任公司
住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(1)B(1)单元
办公地址:上海市徐汇区肇嘉浜路750号
法定代表人:俞涛
电话:021-54067562
传真:021-54067032

联系人:杨莉娟
网址:www.xcsc.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01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.22.23.25层
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:高涛
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539

联系人:高涛
网址:www.china-invs.com
客户服务电话:400-600-8008、953632

联系人:黄健
网址:www.newone.com.cn
客户服务电话:95665

(5)广发证券股份有限公司
住所:广州天河区天河北路183-187号万都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址:广州天河区天河北路183-187号万都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人:孙树明
电话:020-87556888
传真:020-87555417

联系人:黄岚
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益田路4088号招商银行大厦A层18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:王明
电话:010-60833722
传真:010-60833739

联系人:陈忠
网址:www.cs.ecitic.com
客户服务电话:95548

(7)中国银河证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街36号2-6层
办公地址:北京市西城区月坛南街1号院9号
法定代表人:陈共石
电话:010-66563420
传真:010-66568990

联系人:田薇
网址:www.chinastock.com.cn
客户服务电话:4008-889-888或95551

(8)海通证券股份有限公司
住所:上海市淮海中路98号
办公地址:上海黄浦区广东路689号10楼
法定代表人:王开国
电话:021-23219000
传真:021-63410466

3.本基金管理人可以根据情况变化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:周明
联系人:陈文祥
电话:021-68419095
传真:021-68870311
(三)律师事务所
名称:北京市天元律师事务所(特别普通合伙)
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:朱小辉
联系电话:010-57763888
传真:010-57763777

联系人:李皓
经办律师:吴冠雄、李皓
(四)会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号展翼大厦6楼
办公地址:上海市湖滨路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:许慧群、赵曹
经办注册会计师:许慧群、赵曹

4.基金名称
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。

5.基金的类型
本基金类型:交易型开放式。

6.基金的投资目标
紧密跟踪标的的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

七、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,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,基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的80%。

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。

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、成份股个股行权等方式进行替代。

3.衍生品投资策略
本基金股指期货投资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,通过对现货和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,此外,基金还将适度投资于期权等其他衍生品。

本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不得超过2%。