

# 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

2018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]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。

在目前的结果规则下,于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,上海证券账户是指上海证券交易所在A股账户或上海证券交易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现金认购和二级市场交易,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。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。基金投资者欲了解投资基金的具体权利和义务,应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2018年6月23日,有关财务数据和净值表现数据截止日为2018年3月31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8层  
设立日期:1998年4月9日  
法定代表人:杨明辉  
联系人:李彬  
客户服务电话:400-818-6666  
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%
POWER CORPORATION OF CANADA	13.9%
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	13.9%
天津海泰科技发展股份有限公司	10%
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,硕士,高级经济师。现任中信证券股份有限公司党委副书记、执行董事、总经理,执行委员会委员,华夏基金(香港)有限公司董事兼首席财务官。曾任中信证券公司董事、襄理,副总经理,中信控股公司董事、常务副总裁,中信信托董事,中国建设银行证券有限责任公司执行董事、总裁,信诚基金管理有限公司董事长、证通股份有限公司董事等。  
 Barry Sean McInerney 先生:董事,硕士。现任万信投资公司(Mackenzie Financial Corporation)总裁兼首席执行官。曾在多家北美领先的金融机构担任高级管理职位。  
 胡旭六先生: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。  
 葛小波先生:董事,硕士。现任中信证券股份有限公司党委委员、执行委员会委员、财务负责人,兼任 CLSA B.V.董事,CLSA Americas Holdings, Inc.董事,北京中赫国安足球俱乐部有限责任公司董事等。曾任中信证券股份有限公司投资银行部经理和高级经理,A股上市公司办公室副主任,风险控制部副总经理和执行总经理,交易与衍生品业务部、计划财务部、风险管理部、海外业务及固定收益业务行政负责人、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。  
 杨冰先生:董事,硕士。现任中信证券股份有限公司执行委员会委员,资产管理业务行政负责人。曾任中信证券股份有限公司固定收益部交易员,资产管理业务投资经理,资产管理业务投资主管等。  
 李一梅女士:董事、总经理,硕士。兼任证通股份有限公司董事,华夏基金(香港)有限公司董事。曾任华夏基金管理有限公司副总经理、营销总监、市场总监、基金营销部总经理,上海华夏财富投资管理有限公司执行董事、总经理等。  
 张平先生:独立董事,博士。现任中国社会科学院经济研究所研究员,兼任民生证券资产管理公司及香港中航工业国际独立董事,曾任中国社会科学院经济研究所宏观研究室副主任、经济增长室主任、所长助理、副所长,国家金融与发展实验室室副主任等。  
 张宏久先生:独立董事,硕士,现任北京市竞天公诚律师事务所合伙人,兼任博天环境股份有限公司及中信信托有限公司独立董事,全国律师协会外事委员会及金融证券专业委员会副主任,全国侨联法律顧問委员会委员,中国国际经济贸易仲裁委员会、上海国际经济贸易仲裁委员会及吉隆坡地区国际仲裁院仲裁员。  
 张礼卿先生:独立董事,博士,现任中央财经大学金融学院教授(博导),国际金融研究中心主任。兼任保利地产、国英金融科技及瑞丰银行独立董事,中国世界经济学会副会长,中国国际金融学会副秘书长,中国国际经济关系学会、中国城市金融学会常务理事,中国金融学会理事,鸿鑫金融教育基金会常务理事及学术委员会副主任,北京国际金融论坛学术委员等。  
 杨一夫先生:监事长,硕士。现任鲍尔太平有限公司总裁,负责总部加拿大鲍尔协会(Power Corporation of Canada)在中国的投融资活动,兼任三川能源开发有限公司董事,中国投资协会常务理事。曾任国际金融公司(世界银行组织成员)驻中国的首席代表,华夏基金管理有限公司董事等。  
 杨维华先生:监事,硕士。现任中信证券股份有限公司风险管理部B角(主持工作),曾任中信证券股份有限公司风险管理部总监等。  
 史本良先生:监事,硕士,注册会计师。现任中信证券股份有限公司计划财务部B角。曾任中信证券股份有限公司计划财务部总监等。  
 汪贵华女士: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总总监、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,中国政法大学讲师等。

张霄岭先生:副总经理,博士。现兼任华夏基金(香港)有限公司首席执行官,中国石化销售股份有限公司董事,清华大学道口金融学院特聘教授,曾任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主管,中国证监会银行监管部副主任等。

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,曾任银行总行计划资金部副主任科员,主任科员,中国农业发展银行总行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运营、风控主任,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总经理,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经理等。

周慶女士: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助理,曾任职于中国证监会、北京金融街建设开发公司。

2.本基金基金经理  
 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,上证原标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,现任数量投资部总监,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联接基金基金经理(2015年12月21日起任职),中小企业板交易型开放式指数证券投资基金(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),华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2017年12月8日起任职),战略新兴成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2018年7月13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,王路先生任基金经理;2014年12月23日至2017年11月10日期间,张弘弘先生任基金经理。

3.本公司量化投资决策委员会  
 主任:张弘弘先生,华夏基金管理有限公司董事总经理,基金经理。  
 成员:阳琨先生,华夏基金管理有限公司副总经理,投资总监,基金经理。  
 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。  
 宋洋先生,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。

## 二、基金托管人

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:中国银监会银监监[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:010-66060069  
 传真:010-68121816  
 联系人:贺倩

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16日正式成立。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,立足城市和乡村两大市场,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年荣获英国《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,并获有无保留意见的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控标准(ISAE3402)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”。2012年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号;2013年至2017年连续荣获上海清交所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀资产托管机构”称号;2015年、2016年荣获中国银行行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号;2018年荣获中国基金投子的公募基金20年“最佳基金托管银行”奖。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年11月经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,内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部,风险合规部,产品研发与信息部、营运一部、营运二部,市场营销部,内控监督部,账户管理部,朋

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近240名,其中具有高级职称的专家30余名,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2018年1月31日,中国农业银行托管的公开募集证券投资基金共414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,严格监察,确保业务的稳健运行;为基金财产的安全完整,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 and 内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理部,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控管理工作,独立执行监督稽核职能。

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,业务应用系统按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,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  
 基金托管人通过投资监督系统(基金法)、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入和审核,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、基金管理人投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金托管人发现基金管理人违反基金合同的不同情况发生时,将采取以下方式进行处理:  
 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.书面提示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方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)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: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20楼  
 法定代表人:杨德红  
 电话:021-38676161  
 传真:021-38670161  
 联系人:齐敏祺  
 网址:www.gtja.com  
 客户服务电话:95621

(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:北京市朝内大街188号  
 法定代表人:王常青  
 客户服务热线:95587  
 传真:010-65182261  
 联系人:权旭  
 网址:www.cscc.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:0755-82133962  
 联系人:周杨  
 网址:www.guosen.com.cn  
 客户服务电话:95538

(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38-45层  
 办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座40层  
 法定代表人:霍达  
 电话:0755-82943666  
 传真:0755-82943666  
 联系人:黄健  
 网址:www.newone.com.cn  
 客户服务电话:95565

(5)广发证券股份有限公司  
 住所:广州天河区河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)  
 办公地址:广州天河区河北路183-187号大都会广场6、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼  
 法定代表人:孙树明  
 电话:020-87558888  
 传真:020-87556417  
 联系人:黄真  
 网址:www.gf.com.cn  
 客户服务电话:95676或致电各地营业网点

(6)广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座  
 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:张佑君  
 电话:010-60833889  
 传真:010-60839228  
 联系人:田薇  
 网址:www.chinastock.com.cn  
 客户服务电话:4008-888-888或95561

(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:上海市浦东新区广东路689号10楼  
 法定代表人:王开国  
 电话:021-23219000  
 传真:021-63411466  
 联系人:金芸、李昊男  
 网址:www.htsec.com  
 客户服务电话:95553、400-888-8001

(9)申万宏源证券有限公司  
 住所:上海市徐汇区龙乐路989号45层  
 办公地址:上海市徐汇区长乐路969号45层(200031)  
 法定代表人:李梅  
 电话:021-33388824  
 联系人:王雁敏  
 网址:www.swhyc.com  
 客户服务电话:95959

(10)长江证券股份有限公司  
 住所:武汉市新华路新长江证券大厦  
 办公地址:武汉市新华路新长江证券大厦  
 法定代表人:杨泽洋  
 电话:027-65799999  
 传真:027-95481900  
 联系人:李艳  
 网址:www.cjsc.com.cn  
 客户服务电话:95578、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36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36层、28层A02单元  
 法定代表人:王连志  
 电话:0755-82568305  
 传真:0755-82568356  
 联系人:陈剑虹  
 网址:www.axsec.com.cn  
 客户服务电话:95517

(12)西南证券股份有限公司  
 住所:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦  
 法定代表人:吴坚  
 电话:023-63786111  
 传真:023-63786212  
 联系人:张煜  
 网址:www.swsc.com.cn  
 客户服务电话:400-809-6096

(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号湘新城商务中心A栋11楼  
 办公地址:长沙市长沙天心区湘府中路198号湘新城商务中心A栋11楼  
 法定代表人:林俊波  
 电话:021-68634510-8620  
 传真:021-68809580  
 联系人:赵川  
 网址:www.xcsc.com  
 客户服务电话:95351

(14)中信证券(山东)有限责任公司  
 住所:山东省青岛市市南区莱阳路222号1号楼2001  
 办公地址:山东省青岛市市南区东海西路20号龙翔广场东座5层  
 法定代表人:姜晓冲  
 电话:0631-86060165  
 传真:0632-86022005  
 联系人:刘晓明  
 网址:www.zxzd.com.cn  
 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:尹旭航  
 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)东北证券股份有限公司  
 住所:长春市生态大街6666号  
 办公地址:长春市生态大街6666号  
 法定代表人:李福春  
 电话:0431-85096171  
 传真:0431-85096715  
 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8号国联金融大厦  
 办公地址:无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦  
 法定代表人:姚志洪  
 电话:0610-82931662  
 传真:0610-82931062  
 联系人:祁爽  
 网址:www.glsc.com.cn  
 客户服务电话:95570

(19)国都证券股份有限公司  
 住所:北京市东城区东直门内大街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内大街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86号  
 法定代表人:李玮  
 电话:021-20315290  
 传真:021-20315125  
 联系人:许曼晨  
 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(b)单元  
 办公地址:上海市徐汇区虹滨路750号  
 法定代表人:俞萍  
 电话:021-54067552  
 传真:021-54067032  
 联系人:杨颖娟  
 网址:www.cfsc.com.cn  
 客户服务电话:021-32110999、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  
 0102.0306.11.12.13.15.16.19.20.21.22.23号  
 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:0755-88320815  
 传真:0755-82092494  
 联系人:胡芷娟  
 网址:www.china-inv.com  
 客户服务电话:400-600-8008、95532

2.二级市场交易代理券商  
 包括具有经纪业务资格和上海证券业协会会员资格的,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:021-68419096  
 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:010-57763888  
 传真:010-57763777  
 联系人:李晗  
 经办律师:吴冠雄、李晗  
 (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号星展银行大厦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:申峰、赵壹  
 经办注册会计师:申峰、赵壹

四、基金的名称  
 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。

五、基金的类型  
 本基金类型:交易型开放式。

六、基金的投资目标  
 (1)基金进行外汇兑换交易的相关费用。  
 (2)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。  
 (3)标的指数的许可使用费(包括为指数公司缴纳的相关税收以及支付外币相关的汇兑损益、手续费、汇款费等)。  
 (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、律师费和诉讼费。  
 (6)基金份额持有人大会费用。  
 (7)基金的销售交易费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费、融资融券费、证券账户相关费用及其他类似性质的费用)等。  
 (8)基金的银行汇划费用。  
 (9)基金上市费及年费。  
 (10)基金收益分配中发生的费用。  
 (11)基金进行外汇兑换交易的相关费用。  
 (12)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。  
 在中国证监会允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,不需召开持有人大会,具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明。

2. 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0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:  
 H = E × 0.50% × 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,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月5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0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:  
 H = E × 0.10% × 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,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。  
 (3) 标的指数的许可使用费  
 基金合同生效后,标的指数的许可使用费按照基金管理人于指数许可使用费公告中的约定从基金财产中列支。  
 标的指数的许可使用费按前一日基金资产净值的0.04%的年费率计提。计算方法如下:  
 H = E × 0.04% × 当年天数  
 H为每日应计提的标的指数的许可使用费  
 E为前一日的基金资产净值  
 标的指数的许可使用费每日计算,按季支付。本基金及其关联基金标的指数的许可使用费收取下限合计为每季度人民币25万元。计费期间不足一季度的,根据实际天数按日比例计算。  
 如果标的指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整,本基金将采用调整后的方法或费率计算标的指数的许可使用费。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法。  
 (4) 本基金第一(一)款第1)项中第(4)至第(12)项费用根据有关法规及相应协议约定,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。  
 3. 不列入基金费用的项目  
 下列费用不列入基金费用:  
 (一)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。  
 (二)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》生效前所发生的相关费用。  
 (4)其他根据相关法律法规及中国证监会有关规定不得列入基金费用的项目。  
 (二)基金销售费用  
 投资者在申购或赎回基金份额时,申购赎回代理机构可按照不超过0.5%的比例收取佣金,其中包含证券交易费、登记机构等收取的相关费用。

七、基金的投资范围  
 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、金融衍生品工具(包括远期合约、互换、期货、期权等),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,即按标的指数的成份股及其权重构建基金的股票投资组合,并根据标的指数的成份股及其权重的变动对投资组合进行相应调整。

2. 替代性策略  
 对于出现市场流动性不足、因法律法规限制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,基金还将适度运用期权等衍生品进行投资。

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,本基金还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标的指数的收益率。  
 若本基金业绩比较基准发生变更,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应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依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒介上刊登公告。

十、基金的风险收益特征  
 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。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,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。

十一、基金的投资组合报告  
 以下内容摘自本基金2018年第一季度报告:  
 “5.1 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	1,243,160,203.94	99.90
	其中:普通股	1,243,160,203.94	99.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	基金:货币市场基金	-	-
4	金融衍生品投资		