

恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书更新摘要

2019年第四

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联接基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2012年6月14日证监许可[2012]822号文核准募集。本基金基金合同于2012年8月21日正式生效。根据基金管理人2018年9月14日刊登的《华夏基金管理有限公司关于修订恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书的公告》及《华夏基金管理有限公司关于修订恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书的公告》及《华夏基金管理有限公司关于修订恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书的公告》,本基金自2018年9月1日起增聘C类基金份额类别。

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必然不会发生损失。

本基金为恒生ETF的联接基金,本基金净值会因为恒生ETF净值波动等因素产生波动,恒生ETF净值波动的主要原因是:跟踪其资产净值波动可能超过跟踪误差,本基金的风险,投资者在购买前应当认真阅读基金合同、招募说明书和基金产品资料概要。本基金投资中的风险包括:香港市场政治、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;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;本基金特定投资风险。本基金为恒生ETF联接基金,主要通过投资恒生ETF跟踪标的指数的表现,与恒生ETF投资风格、交易方式等方面存在较大区别。恒生ETF为股票型指数基金,因此本基金的风险与收益高于债券基金、货币基金与货币市场基金。

本基金的目标ETF主要投资于香港市场以港币计价的金融工具,本基金除投资目标ETF外,也可投资于国内证券市场,港币相对于人民币的汇率波动可能会影响本基金的资产净值。投资者在购买前应当仔细阅读基金合同、招募说明书和基金产品资料概要。本基金投资中的风险包括:香港市场政治、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;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;本基金特定投资风险。本基金为恒生ETF联接基金,主要通过投资恒生ETF跟踪标的指数的表现,与恒生ETF投资风格、交易方式等方面存在较大区别。恒生ETF为股票型指数基金,因此本基金的风险与收益高于债券基金、货币基金与货币市场基金。

本基金的目标ETF主要投资于香港市场以港币计价的金融工具,本基金除投资目标ETF外,也可投资于国内证券市场,港币相对于人民币的汇率波动可能会影响本基金的资产净值。投资者在购买前应当仔细阅读基金合同、招募说明书和基金产品资料概要。本基金投资中的风险包括:香港市场政治、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;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;本基金特定投资风险。本基金为恒生ETF联接基金,主要通过投资恒生ETF跟踪标的指数的表现,与恒生ETF投资风格、交易方式等方面存在较大区别。恒生ETF为股票型指数基金,因此本基金的风险与收益高于债券基金、货币基金与货币市场基金。

投资者有风险,投资需谨慎。投资者在投资本基金之前,请仔细阅读本基金招募说明书,全面了解本基金的投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、费率结构、流动性限制等重要信息,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。基金的投资有风险,申购赎回并不等于未来表现,但不保证本金一定获利,也不保证资产一定增值,投资者应自行承担投资风险。

本摘要概括本基金合同和招募说明书的精华,并经过中国证监会核准,但基金合同是约定基金当事人之间权利义务关系的核心法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额时,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为即表明其同意接受基金合同的约束,并承担相应的法律后果。基金合同可以通过买入恒生指数成份股来跟踪标的指数的,为了更好地实现投资目标,本基金可投资于境外证券市场,基金资产中投资于境外股票、债券、货币市场工具等资产,并在法律法规允许的范围内进行证券申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等基金业务。

正常情况下,本基金投资于目标ETF的资产不低于基金资产净值的90%(已回购但未确认的目标ETF份额计入在内)。

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

一、基金名称
本基金名称:恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金

二、基金类型
本基金类型:契约型开放式

三、基金的投资目标
本基金主要通过投资于恒生ETF基金份额的投资,追求跟踪标的指数,获得与指数收益相类似的投资回报。

四、基金的投资方向
本基金主要投资于目标ETF基金份额和标的指数的股票组合,基金在境内可投资于证券市场工具等法律法规和中国证监会认可的金融工具。此外,本基金还可投资于境外证券市场,基金资产中投资于境外股票、债券、货币市场工具等资产,并在法律法规允许的范围内进行证券申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等基金业务。

五、基金的投资策略
本基金主要通过投资于目标ETF基金份额和标的指数的股票组合,基金在境内可投资于证券市场工具等法律法规和中国证监会认可的金融工具。此外,本基金还可投资于境外证券市场,基金资产中投资于境外股票、债券、货币市场工具等资产,并在法律法规允许的范围内进行证券申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等基金业务。

六、业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:恒生ETF基金份额的指数收益率×96%+人民币活期存款利率×4%,其中,恒生ETF基金份额的指数为人民币港币汇率×恒生指数,人民币活期存款利率是指中国人民银行公布的金融机构人民币活期存款基准利率。

七、风险收益特征
本基金为恒生ETF的联接基金,恒生ETF为股票型指数基金,因此本基金的风险与收益高于债券基金、货币基金与货币市场基金。

以下内容摘自本基金2018年第四季度报告:

“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	—	—
2	其中:普通股	—	—
3	固定收益投资	824,522,931.19	91.46
4	金融衍生品投资	—	—
5	其中:国债	—	—
6	其中:央行票据	—	—
7	其中:中期票据	—	—
8	其中:短期融资券	—	—
9	其中:资产支持证券	—	—
10	其他投资	3,623,826.16	0.40
11	合计	901,463,916.14	100.00

5.2报告期末在各国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未有存托凭证投资

5.3报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合
本基金本报告期末未有股票及存托凭证

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
本基金本报告期末未有股票及存托凭证

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五名债券投资明细
本基金本报告期末未有债券

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资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未有资产支持证券

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五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未有贵金属

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股指期货投资明细
本基金本报告期末未有股指期货

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权证投资明细
本基金本报告期末未有权证

5.10报告期末本基金投资的股指期货投资是否符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名股票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、处罚的情况

5.11报告期末本基金投资的国债逆回购投资是否符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名国债逆回购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、处罚的情况

5.12本基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库

5.13报告期末,本基金投资的前十名股票中,没有投资于违反国家法律法规规定,或本基金合同有明确禁止的投资品种

5.14报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.15报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.16报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.17报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.18报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.19报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.20报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.21报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.22报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.23报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.24报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.25报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.26报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.27报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.28报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.29报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.30报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.31报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.32报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.33报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.34报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.35报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.36报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.37报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.38报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.39报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.40报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.41报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.42报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.43报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.44报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.45报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.46报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.47报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.48报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.49报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.50报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.51报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.52报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券

(一)基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率,并调低赎回费率。费率发生变更,基金管理人应在调整实施前3日前至少一种指定媒体上刊登公告。

(二)基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的前提下根据市场情况制定基金促销计划,经代销机构同意后,针对投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,基金管理人可以在符合中国证监会相关规定的前提下,对投资者适当调低基金申购费率、赎回费率并调整收费。

(三)基金管理人可以根据相关法律法规及基金合同的约定,采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性,具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规及监管部门、自律规则的规定。

2、申购份额与赎回金额的计算方式
(1)申购份额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(2)赎回金额的计算
赎回金额=赎回份额×赎回当日基金份额净值

(3)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(4)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(5)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(6)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(7)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(8)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(9)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(10)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(11)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(12)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(13)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(14)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(15)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(16)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(17)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(18)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(19)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(20)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(21)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(22)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(23)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(24)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(25)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(26)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(27)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(28)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(29)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(30)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(31)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(32)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(33)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(34)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(35)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(36)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(37)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(38)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(39)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(40)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(41)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(42)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(43)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(44)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(45)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(46)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(47)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(48)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(49)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(50)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(51)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(52)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(53)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(54)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(55)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(56)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(57)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(58)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(59)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(60)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(61)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(62)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(63)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(64)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(65)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率

(66)申购份额与赎回金额的计算
申购份额=申购金额÷申购当日基金份额净值

(67)申购费用和赎回费用的计算
申购费用=申购金额×申购费率