

# 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

2013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]822号文核准募集。本基金基金合同于2012年6月9日正式生效。

基金管理人在本基金招募说明书中的内容真实、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没有风险。

本基金主要投资于香港证券市场,基金净值会因香港证券市场价格波动等因素产生波动,投资者根据持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。本基金投资中包含的因素,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汇率风险;基金所投资的股票、债券、衍生品等各种投资对象的相对风险;由于基金份额持有人连大额赎回基金产生的流动性风险;本基金的流动性风险等。

本基金是股票基金,高风险且具备市场基金、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。

本基金为投资香港市场的ETF,基金份额的清算交收和境内普通ETF存在一定差异,通常情况下,T日申购的基金份额在T+4日才可能卖出或赎回。投资者认购本基金时需有深圳证券账户,但需注意,使用基本账户只能参与本基金的现金认购和一级市场交易,如投资者需要参与基金的申购、赎回,则应使用A股账户。本基金人民币募集资金和计价、申购、赎回均以人民币进行,而在投资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影响基金份额净值。

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。

基金经理的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人恪尽职守,诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本招募说明书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获得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金的当事人,其持有基金份额的行使其本身即表明其对基金合同的承认和接受。并按照基金合同、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。

本招募说明书载明截止日期为2013年2月9日,有关财务数据和净值表现数据截止日期为2012年12月31日。本招募说明书中的财务资料未经审计。

## 一、基金的名称

恒生交易型开放式指数证券投资基金。

## 二、基金的类型

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,基金还可投资于债券、基金、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其投资的其他金融工具。

本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。

本招募说明书载明截止日期为2013年2月9日,有关财务数据和净值表现数据截止日期为2012年12月31日。本招募说明书中的财务资料未经审计。

## 五、基金的投资策略

本基金主要采取复利策略及适当的替代性策略以更好的跟踪指数的投资目标。

## (一)组合复利策略

本基金主要采取复利策略,即按照标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行调整,从而优先选择其他品种的,基金管理人在履行适当程序后,可以将资金投入投资范围。

## (二)替代性策略

对于出现流动性不足,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于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。

## (三)衍生品投资策略

由于本基金赎回后采取现金方式,考虑到申购赎回资金流动冲击以外汇兑、货币划转的操作风险,基金将保留一定的现金头寸用于满足赎回后香港证券交收要求,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标的指数为基础的衍生产品(如期货、期权等)以更好地跟踪标的指数,实现投资目标。

本基金力争头寸均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过2%。

未来,随着投资工具的发展和丰富,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:经人民币汇率调整后的恒生综合指数。

若基金的指数发生变更,基金管理人将根据实际情况调整基金的基准比例。

基金管理人可根据投资情况和市场惯例调整基金的基准比例。

本基金力争头寸均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过2%。

未来,随着投资工具的发展和丰富,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,并在招募说明书中公告。

## 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。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。

本基金为境外证券投资的基金,主要投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。除了不能直接参与境内证券投资基金类别的市场风险外一般投资风险之外,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、基金的投资组合报告

基金管理人声明本基金所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担责任。

基金托管人中国银行根据本基金合同规定,于2013年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本基金组合报告所载数据截至2012年12月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

## (一)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 权益投资 250,219,287.12 53.68

其中:普通股 250,219,287.12 53.68

2 基金投资 - -

3 固定收益投资 - -

其中:债券 - -

4 货币市场工具 - -

5 其他资产 - -

6 负债合计 195,031,010.09 41.84

7 银行存款和结算备付金合计 20,843,744.14 4.47

8 其他各项资产 466,094,043.15 10.00

9 合计 250,219,287.12 55.07

注:以上分类采用行业分类标准(GICS)。

(二)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

金额单位:人民币元

序号 国家(地区) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

1 中国香港 250,219,287.12 55.07

注: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

序号 行业类别 公允价值 占基金资产净值比例(%)

1 金融 147,433,925.47 32.45

2 能源 31,206,826.03 6.87

3 电信服务 21,399,397.70 4.71

4 公用事业 12,793,388.80 2.82

5 工业 10,244,183.50 2.25

6 信息技术 9,803,536.52 2.16

7 非必需消费品 9,280,238.37 2.04

8 必需消费品 7,556,286.06 1.66

9 材料 501,312.59 0.11

10 保健 - -

注:所用行业代码采用当地市场代码。

(三)报告期末按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。

(四)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金报告期末未持有债券。

(五)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

本基金报告期末未持有债券。

(六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

本基金报告期末未持有债券。