

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8月9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;个股或行业因素对证券价格产生影响而形成的非系统性风险;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和混合基金。本基金主要投资于标的指数的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+2日才可以卖出或赎回。投资者认购本基金时需与深圳证券账户,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。本基金以人民币募集和计价,经过换汇后主要投资于香港证券市场计价的金融工具,人民币对港币的汇率的波动可能加大基金净值波动,从而对基金业绩产生影响。

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。

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。

本招募说明书所载内容截止日为2013年2月9日,有关财务数据和净值表现数据截止日为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

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最小化。

四、基金的投资方向

本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股,替代股票,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、交易型货币基金)、金融衍生品(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的,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入基金投资范围。

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法,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投资组合进行相应地调整。

(二)替代性策略
当出现市场流动性不足,因法律法规原因对个别成份股限制投资等情况,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。

(三)衍生品投资策略
由于本基金申购赎回采用现金方式,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,基金将会保留一定的现金头寸用于满足赎回及香港证券交易要求。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标的指数为基准的衍生产品(如期货、期权等)来对冲跟踪标的指数的指数,实现投资目标。

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%。

未来,随着投资工具的发展 and 丰富,基金管理人可以在不改变投资目标的前提下,相应调整和优化相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。

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对港币汇率×恒生指数。

若基金标的指数发生变更,基金业绩比较基准随之变更,基金管理人可根据标的指数和市场行情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的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

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述等,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司,于2013年1月17日复核了本报告中的财务资料、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。

本投资组合报告所载数据截至2012年12月31日,本报告中列示的财务数据未经审计。

(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	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	250,219,287.12	53.68
	其中:普通股	250,219,287.12	53.68
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:国债	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	买入返售金融资产	-	-
5	货币市场工具	195,031,010.09	41.84
6	其他各项资产	20,843,744.14	4.47
7	合计	466,094,041.35	100.00
注:股票投资的公允价值包含可替代替代的公允价值。			
(二)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	250,219,287.12	53.68	
(三)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	147,433,925.47	32.45	
能源	31,206,826.03	6.87	
电信服务	21,399,397.70	4.71	
公用事业	12,793,380.90	2.82	
工业	10,244,183.50	2.25	
信息技术	9,803,536.52	2.16	
非必需消费品	9,280,238.37	2.04	
必需消费品	7,556,286.06	1.66	
材料	501,512.99	0.11	
保健	-	-	
合计	250,219,287.12	53.68	
注:以上分类采用全球行业分类标准 GICS。			
(四)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)	公允价值
1	HSBC HOLDINGS PLC	汇丰银行有限公司	563,860
2	CHINA MOBILE LTD	中国移动通信集团有限公司	263,824
3	CONSTRUCTION BANK	中国工商银行股份有限公司	3,666,792
4	INDA COM CHINA	中国工商银行股份有限公司	3,216,668
5	ALIA GROUP LTD	利华控股有限公司	472,827
6	CNOOC LTD	中国海洋石油有限公司	779,862
7	TENECENT HOLDINGS LTD	腾讯控股有限公司	48,556
8	BANK OF CHINA LTD	中国银行股份有限公司	3,462,992
9	PETROCHINA CO LTD	中国石油化工股份有限公司	922,528
10	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	中国人寿保险股份有限公司	325,974

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(五)报告期末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

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	股指期货	HANG SENG DEX FUT Jan13	-	-
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。				
代码	名称	持仓量(无美)	合约市值	公允价值变动
HIF3	HANG SENG DEX FUT Jan13	208	191,518,120.46	-391,681.09
总额合计				-391,681.09
股指期货持仓明细				-391,681.09

(六)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

本基金本报告期末未持有基金。

(七)投资组合报告附注

1.报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券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、处罚的情形。

2.本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

3.期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	11,862,020.68
2	应收证券清算款	8,962,045.32
3	应收股利	8,209.61
4	应收利息	11,468.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,843,744.14

4.报告期末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持有处于转股期的可转换债券。

5.报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

6.投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

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。基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列指标。

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准增长率②	份额净值增长率③	业绩比较基准增长率④	①-③	②-④
2012年9月9日至2012年12月31日	3.37%	0.54%	12.03%	0.89%	-8.66%	-0.35%

十、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号新大厦B座12层

设立日期:1998年4月9日

法定代表人:王东明

联系人:李刚

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	49%
南方工业资产管理有限责任公司	11%
山东省农村经济开发投资公司	10%
POWER CORPORATION OF CANADA	10%
青岛海鹏科技投资有限公司	10%
无锡锡国联发展(集团)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

王东明先生:董事长,硕士,高级经济师。现任中信证券股份有限公司董事长、执行董事兼执行管理委员会委员、中国中信股份有限公司总经理助理,中信控股执行委员会董事,中信国际信托有限公司董事,中信证券国际有限公司非执行董事。曾任国际大丰银行证券行公司董事、投资银行部、曾任华夏证券有限责任公司市场部总经理,南方证券有限公司副总经理,中信证券股份有限公司副总经理、总经理、董事,中信信托控股有限公司执行董事。

李刚先生:副董事长,博士,高级经济师。现任华夏基金管理有限公司党委书记,北京人民代表,北京市顺义区人大代表,兼任北京市金融办金融办监事长。曾任中国建设银行总行干部,华夏证券有限公司北京东部营业部总经理、总裁助理、华北区总监(副总裁)、华夏基金管理有限公司总经理。第三、四届中国证监会发审委委员。

华伟先生:董事,硕士,高级会计师。现任无锡市国联发展(集团)有限公司副总裁、国联信托股份有限公司董事长。曾任无锡市财政局管理科科长、综合计划科科长、综合计划科副科长,无锡市信托投资公司部门经理、总经理助理,国联证券有限责任公司董事、总裁、国联基金管理有限责任公司董事长。

胡祖六先生:董事,博士,教授。现任春华资本基金主席,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。

徐刚先生:董事,博士,经济师。现任中信证券股份有限公司执行委员会董事、董事总经理、经济业务发展与管理委员会主任委员、研究部行政负责人。曾任中国地质机械进出口总公司干部,曾任职于中信证券股份有限公司资产管理部、资产管理部、金融产品开发小组、金融部、研究部、销售管理部,担任经理、高级经理、部门副总经理、部门总经理、部门行政负责人等职务。

葛小波先生:董事,硕士。现任中信证券股份有限公司执行委员会董事、董事总经理、计划财务部执行委员会董事。曾任中信证券股份有限公司投资银行部高级经理、上市部副主任、风险控制部执行总经理、交易部、现交易与衍生品业务部行政负责人。

吴武祥先生: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、副主任。曾任北京航空航天大学教授、北京航空航天大学(控股)有限公司、歌尔声学股份有限公司独立董事,中国金融学会常务理事。

贾建平先生:独立董事,大学本科学历,高级经济师。现已退休。曾任职于北京工艺品进出口公司、美国纽约中国物产有限公司(外派工作)、曾担任中国银行信托咨询公司副行长、处长、中国银行广泰基金公司副总经理,中国银行意大利代表处首席代表,中国银集团投资有限公司副董事长、总经理,中国银行重组上市办公室、董事会秘书办公室、上市公司办公室总经理、副经理。

谢卫先生:独立董事,博士,教授。现任清华大学经济管理学院会计学院教授、博士生导师,兼任北京超图软件股份有限公司、方力环境股份有限公司、北京杰创世纪股份有限公司独立董事,中国会计学会 会计研究编委、中国会计学会财务成本分会第七届理事会副会长、国家自然科学基金和国家社会科学基金通讯评审专家、教育部科技研究中心科研基金和科技奖励评审专家、学位与研究生教育发展研究中心主任。曾任清华大学、中国农业大学会计学讲师、副教授。

滕天鸣先生:独立董事,硕士。曾任机构管理部总经理、公司总经理助理、公司副总经理等。

张后先生:副总经理,博士。曾任公司总经理助理。

刘文明先生:副总经理,硕士。曾任公司总经理助理等。

吴志军先生:副总经理,学士。曾任上海分公司总经理、市场总监、公司总经理助理等。

林浩先生:副总经理,硕士。曾任公司总经理助理等。

方路捷女士:督察长,硕士。曾任中国金融出版社工作。

李红钢先生:副总经理,硕士,高级经济师。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职员,中国兵器工业总公司教育职员、主任科员、规划处副处长、计划处长,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、资本运营部副部长兼副主任。

于少明先生:监事,大学本科学历,高级会计师。现任山东省农村经济开发投资公司总经理、山东高速集团有限公司总经理助理、山东高速投资有限公司总经理。曾任西藏地局局驻西安行办、矿产十一队职员,山东省交通厅公路局科长,山东省公安厅主任科员、副主任,山东基建股份有限公司总经理。

吕翔先生:监事,学士。现任中信证券股份有限公司资产管理部执行总经理。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执行总经理。

刘义先生:监事,工商管理硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员、养老金业务总监。曾任中国人民银行总行计划资金司副主任科员、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监事、党办主任、养老金业务总监等。

查尔斯·罗斯先生:监事,学士,注册会计师。现任北方基金基金公司总裁兼首席执行官,IGM基金公司联席首席执行官兼行政负责人。曾任任职于加拿大多伦多市的Coopers & Lybrand公司,曾任富勒诺普顿投资公司在加拿大多伦多支机构的首席财务官和销售主管,富勒诺普顿投资公司加利福尼亚州国际总部副总经理、公司行政总裁,另外,曾任职于FundService公司董事,并曾担任加拿大投资基金协会(IFIC)董事成员、理事会成员。

张弘波先生: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等,现任数量投资部副总经理,华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理。华夏沪深300指数证券投资基金基金经理。

查尔斯·罗斯先生:监事,学士,注册会计师。现任北方基金基金公司总裁兼首席执行官,IGM基金公司联席首席执行官兼行政负责人。曾任任职于加拿大多伦多市的Coopers & Lybrand公司,曾任富勒诺普顿投资公司在加拿大多伦多支机构的首席财务官和销售主管,富勒诺普顿投资公司加利福尼亚州国际总部副总经理、公司行政总裁,另外,曾任职于FundService公司董事,并曾担任加拿大投资基金协会(IFIC)董事成员、理事会成员。

滕天鸣先生:独立董事,硕士。曾任机构管理部总经理、公司总经理助理、公司副总经理等。

程海泳先生:华夏基金管理有限公司总经理助理、投资总监、股票投资部总监,华夏兴发股票型证券投资基金基金经理。

周全先生:华夏基金管理有限公司国际投资部总监,华夏全球精选股票型证券投资基金基金经理。

崔强先生:华夏基金管理有限公司国际投资部副总监,华夏全球精

选股票型证券投资基金基金经理。

刘旦旦先生:华夏基金管理有限公司固定收益部副总经理,华夏海外收益债券型证券投资基金基金经理。

4.上述人员之间不存在近亲属关系。

十一、费用概览

(一)基金运作费用

1.基金费用的种类

(1)基金管理人的管理费。

(2)基金托管人的托管费(含境外资产托管人收取的费用)。

(3)标的指数使用许可费(包括为指数公司缴纳的相关税收以及支付与外币相关的汇兑损益、手续费、汇款费等)。

(4)基金上市费及年费。

(5)因基金的证券交易或结算产生的费用(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)。

(6)基金合同生效以后的信息披露费用。

(7)基金合同生效以后的会计师费和律师费。

(8)基金的资金汇划费用。

(9)基金收益分配中产生的费用。

(10)基金进行外汇兑换交易的相关费用、汇款费。

(11)基金为基金资产估值而产生的费用,如代表基金股票产生的费用、与基金有关的诉讼费、追索费等。

(12)按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

(13)基金合同生效以前基金财产中列支的其他费用。

(14)根据国际有关法规可以在基金财产中从基金财产中计提销售服务费,具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明。

上述基金费用由基金管理人按法律法规规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.60%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.60%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.60%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

(2)基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.15%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.15%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

(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方可签署的指数使用许可协议的约定从基金财产中支付。

根据指数使用许可协议,目前指数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为每日应计提的指数许可使用费

E为前一日基金资产净值

标的指数许可使用费每日计算,按季支付。每年应支付的标的指数许可使用费低于指数许可使用协议规定的下限。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的方法、费用和支付方式等发生变化,本基金将采用调整的方法或费率计算指数许可使用费,基金管理人将在招募说明书更新或其他公告披露基金最适用的方法。

(4)本条第(一)款第1)项至第(4)项小项费用由基金管理人和本基金托管人根据有关规定及相应协议的规定,列入或摊入当期基金费用。

3.不列入基金费用的项目

(1)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,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

(2)基金费用调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费,无需召开基金份额持有人大会。

(三)申购赎回费用

1.申购对价是指投资者申购基金份额时应支付的现金替代、现金差及其他对价。赎回对价是指投资者赎回基金份额时,基金管理人应交付给赎回人的现金替代、现金差额及其他对价。申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和申购、赎回的基金份额数额确定。

2.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%的标准收取佣金,其中包含证券交易费、登记结算机构等收取的相关费用。

3. 基金的基金份额净值在当日收市后计算,并在T+1日公告;计算公

式为:估值日基金资产净值除以估值日基金份额总额。如遇特殊情况,可以适当延迟计算或公告,并报中国证监会备案。T日的申购赎回清单在当日深圳证券交易所开市前公告。未来,若市场情况发生变化,或相关业务规则发生变化,或实际情况需要,基金管理人可以在不违反相关法律法规的情况下对基金份额净值、申购赎回清单计算和公告时间或频率进行调整并提前公告。

十二、基金托管人

(一)基本情况

名称:中国银行股份有限公司 简称“中国银行”

住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期:1983年10月31日

注册资本:人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟玖佰玖拾元

法定代表人:肖钢