

易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书摘要

重要提示

本基金根据2012年6月18日中国证券监督管理委员会《关于核准易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》(证监许可[2012]82号)和2012年6月29日《关于易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集方案安排的确认函》(基金部函[2012]548号)的核准,进行募集。本基金的基金合同于2012年5月9日正式生效。

本摘要根据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。基金投资人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。基金份额持有人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细阅读基金合同。

基金投资人依照尽职、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。

本基金投资于证券交易所上市的股票,基金净值会因为证券期货市场波动等因素产生波动,投资有风险。投资人应在投资本基金前,请认真阅读《基金合同》、《招募说明书》,全面认识本基金产品的风险收益特征,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量及投资行为作出独立决策,并承担基金投资中可能出现的各类风险。投资本基金可能遇到的主要风险包括:(1)本基金特有的风险,主要包括标的指数的风险、标的指数回报率与股票市场平均回报率偏高的风险、标的指数回报率与股票市场价格波动风险等;(2)基金管理人的风险,基金管理人代理申赎投资者买卖券的风

险、退市风险、申购失败的风险、赎回失败的风险、投资者参加IOPV等。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

本基金由易方达基金管理有限公司独立管理,未聘请境外投资顾问。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

在目前的监管规则下,投资者当日申购的基金份额,清算交收完成后方可卖出和赎回,即T日申购的基金份额,T+1日交收成功后T+2日可卖出或赎回。当日买入的基金份额,同日可以赎回,但不得卖出。由于登记结算机构对现金替代券采取非全额赎回交收模式,当投资者赎回时应将登记结算机构确认后,被赎回的基金份额即被记账,但此时投资者未收到赎回款项而代替款。投资者投资本基金时需具有证券账户,证券账户是在上海证券交易所A股账户或上海证券交易所证券投资基金账户。

投资者一旦认购、申购或赎回本基金,即表示对基金认购、申购和赎回所涉及的基金份额的变更更登记方式以及申购赎回所涉及现金替代的确认已认可。

本招募说明书所载内容截止日为2013年2月9日,有关财务数据截止日为2012年12月31日,净值表现截止日为2012年12月31日。(本报告中财务数据未经审计)

一、基金的名称

易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金

二、基金的类型

本基金为交易型、开放式、境外股票指数基金

三、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

四、基金的投资方向

本基金投资于标的指数成份股,备选成份股、境外交易的跟踪

该类的指数的公募基金,依法发行或上市的其他股票、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具、跟踪同一标的指数的股指期货等金融衍生品和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金根据相关法律法规或中国证监会会未来允许基金投资的其它金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。

基金投资标的指数成份股,备选成份股的资产不低于基金资产

净值的95%。

五、基金的投资策略

本基金主要采取组合复制策略和适当的替代性策略实现对标的指数的紧密跟踪。同时,本基金可适当借出证券,以更好实现本基金的投资目标。

(一)组合复制策略

本基金主要采取完全复制法进行投资,即参考恒生中国企业指

数成份股及权重构建股票投资组合,并根据恒生中国企业指

数成份股及权重变动对股票投资组合进行相应调整。

(二)替代性策略

当市场流动性不足,法规规定本基金不能投资关联方股票等情

况导致本基金无法按照指数构成及权重进行组合构建时,基金管理人将通过投资其他成份股、成份股个别品种进行替代,为进行流动性管理,应付赎回,降低跟踪误差以及提高投资效

率,本基金将择机将部分跟踪误差控制在3%以内。

六、基金的业绩比较基准

恒生中国企业指数(使用估值汇率折算)

本基金基金投资于境外股票指数,本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资香港证券市场上的中国企业,需承担汇率风险以及境外市场的风

险。

八、基金投资组合报告(未经审计)

本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。

本基金的托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同的规定,已于2013年3月15日就本报告的内容,报备核查后不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本基金投资组合报告有关数据的期间为2012年10月1日至2012年12月31日。

1.1.报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(人民币元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 392,704,579.06 96.79

其中:普通股 392,704,579.06 96.79

2 固定收益投资 - -

3 国际化投资收益 - -

4 买入返售金融资产 - -

其中:买断式回购的买入返售金融资产 - -

5 买入返售金融资产 - -

6 其他资产 7,619,538.78 1.88

7 存款和存券及存放同业合计 7,619,538.78 1.88

8 其他资产 5,389,717.74 1.33

9 合计 405,794,035.58 100.00

注:上表中的普通股投资金额可替代代款估值增值,而3的合计项不含可替代代款估值增值。

2.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

国家(地区) 公司(人民币元) 占基金资产净值比例(%)

注:1.国家(地区)类别根据其所在的证券交易所确定。

2.ADR、GDR按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

3.报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

(1)报告期末按投资行业分类的股票及存托凭证投资组合

序号 项目 公司(人民币元) 占基金资产净值比例(%)

1 信息技术 91,170,000.00 23.10

2 生物技术 181,463,577.00 5.02

3 制造业 15,220,359.95 3.86

4 快消品 2,374,166.80 0.58

5 金融 4,664,836.27 1.18

6 电信 232,263,064.73 58.85

7 电子 1,296,179.40 0.33

8 其他 9,484,300.00 2.29

9 公用事业 5,245,001.70 1.28

10 采掘 392,704,579.06 96.79

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

(2)报告期末积极投资行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金报告期末无积极投资的股票及存托凭证。

4.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票及存托凭证投资明细

(1)按报告期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

序号 公司名称(中文) 公司名称(英文) 证券代码(或简称) 所在市场(地区) 所属国家(地区) 数量(股) 公允价值(人民币元) 占基金资产净值比例(%)

1 Bank Of China Limited 中国银行股份有限公司 3988 HK 香港证券交易所 香港 13,819,000 369,771.08 9.82

2 Industrial And Commercial Bank Of China Limited 中国工商银行股份有限公司 398 HK 香港证券交易所 香港 8,659,000 58,616,325.83 9.78

3 China Construction Bank Corporation 中国建设银行股份有限公司 399 HK 香港证券交易所 香港 7,627,000 58,446,675.35 9.75

4 PetroChina Company 中国石油天然气股份有限公司 857 HK 香港证券交易所 香港 1,123,000 56,968,714.23 9.30

5 China Life Insurance Company Limited 中国平安保险(集团)股份有限公司 288 HK 香港证券交易所 香港 1,453,000 50,897,575.77 7.55

6 China Petroleum And Chemical Corporation 中国石油化工股份有限公司 328 HK 香港证券交易所 香港 3,276,000 53,222,705.59 7.51

7 Ping An Insurance (Group) Company Of China, Ltd. 中国平安保险(集团)股份有限公司 231 HK 香港证券交易所 香港 395,500 18,251,301.02 4.62

8 China Shenhua Energy Co., Ltd. 中国神华能源股份有限公司 108 HK 香港证券交易所 香港 663,000 18,251,301.02 4.62

9 Agricultural Bank Of China Limited 中国农业银行股份有限公司 368 HK 香港证券交易所 香港 4,510,000 14,006,553.31 3.55

10 China Merchants Bank 招商银行股份有限公司 398 HK 香港证券交易所 香港 763,000 10,559,403.21 2.68

注:上述所列的股票代码是当地股票代码。

(2)未积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票及存托凭证投资明细

本基金报告期末无积极投资的股票及存托凭证。

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存托凭证投资明细

本基金报告期末无持有存托凭证。

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金融衍生品投资明细

本基金报告期末未持有金融衍生品。

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十五名基金投资明细

本基金报告期末持有基金。

10.投资组合报告附注

本基金组合的前十名证券的发行主体本期没有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没有超出基金合同规定的备选股票库。

11.投资组合报告附注

本基金组合的前十名证券的发行主体本期没有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。

12.投资组合报告附注

本基金组合的前十名证券的发行主体本期没有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。

13.投资组合报告附注

本基金组合的前十名证券的发行主体本期没有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。

14.投资组合报告附注

本基金组合的前十名证券的发行主体本期没有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。

15.投资组合报告附注

本基金组合的前十名证券的发行主体本期没有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。

16.投资组合报告附注

本基金组合的前十名证券的发行主体本期没有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。

17.投资组合报告附注

本基金组合的前十名证券的发行主体本期没有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。

18.投资组合报告附注

本基金组合的前十名证券的发行主体本期没有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。

19.投资组合报告附注

本基金组合的前十名证券的发行主体本期没有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。

20.投资组合报告附注

本基金组合的前十名证券的发行主体本期没有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。

21.投资组合报告附注

本基金组合的前十名证券的发行主体本期没有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。

22.投资组合报告附注

本基金组合的前十名证券的发行主体本期没有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。

23.投资组合报告附注

本基金组合的前十名证券的发行主体本期没有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。

24.投资组合报告附注

本基金组合的前十名证券的发行主体本期没有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。

25.投资组合报告附注

<p