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

2014年第2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；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，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具有深圳证券账户，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市场以港币计价的金融工具，人民币对港币的汇率的波动可能加大基金净值的波动，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。

本招募说明书所载内容截止日为2014年8月9日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2014年6月30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，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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，即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股票投资组合进行相应地调整。

（二）替代性策略

对于出现市场流动性不足、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取现金方式，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以标的指数为基础资产的衍生产品（如期货、掉期等）以更好地跟踪标的指数，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/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。

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、误导性陈述或重大遗漏，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根据本基金合同规定，于2014年7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。

本投资组合报告所载数据截至2014年6月30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	120,398,753.03	95.95
	其中：普通股	120,398,753.03	95.95
	存托凭证	–	–
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
	其中：远期	–	–
	期货	–	–
	期权	–	–
	权证	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	货币市场工具	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	3,948,332.46	3.15
8	其他各项资产	1,127,235.05	0.90
9	合计	125,474,320.54	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

（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	120,398,753.03	96.07
合计	120,398,753.03	96.07

（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	64,669,253.44	51.60
信息技术	14,191,678.12	11.32
能源	11,452,608.43	9.14
电信服务	8,223,887.62	6.56
公用事业	6,166,312.75	4.92
非必需消费品	6,149,809.51	4.91
工业	5,163,517.97	4.12
必需消费品	4,381,685.19	3.50
材料	–	–
保健	–	–
合计	120,398,753.03	96.07

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）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	HSBC HOLDINGS PLC	汇丰控股有限公司	00005	香港	中国香港	283,418	17,682,094.75	14.11
2	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股有限公司	00700	香港	中国香港	133,930	12,565,480.01	10.03
3	CHINA CONSTRUCTION BANK	中国建设银行股份有限公司	00939	香港	中国香港	1,726,692	8,031,492.00	6.41
4	CHINA MOBILE LTD	中国移动有限公司	00941	香港	中国香港	125,944	7,517,597.36	6.00
5	AIA GROUP LTD	友邦保险控股有限公司	01299	香港	中国香港	186,953	5,779,944.11	4.61
6	IND & COMM BK OF CHINA	中国工商银行股份有限公司	01398	香港	中国香港	1,315,154	5,115,127.09	4.08
7	BANK OF CHINA LTD	中国银行股份有限公司	03988	香港	中国香港	1,632,856	4,497,395.69	3.59
8	CNOOC LTD	中国海洋石油有限公司	00883	香港	中国香港	372,487	4,115,608.86	3.28
9	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	长江实业（集团）有限公司	00001	香港	中国香港	31,277	3,413,591.33	2.72
10	SUN HUNG KAI PROPERTIES	新鸿基地产发展有限公司	00016	香港	中国香港	38,867	3,279,427.42	2.62

注：所用证券代码采用当地市场代码。

（五）报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本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序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

（七）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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（八）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

金额单位：人民币元

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 IDX FUT Jul14	–	–
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）：

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）（单位：手）	合约市值	公允价值变动
HIN4	HANG SENG IDX FUT Jul14	3	2,750,958.37	5,119.69
公允价值变动总额合计		–	–	5,119.69
股指期货投资本期收益		–	–	196,893.43
股指期货投资本期公允价值变动		–	–	–45,556.21

（九）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。

（十）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、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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	171,926.25
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	924,567.77
4	应收利息	493.94
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	30,247.09
8	其他	–
9	合计	1,127,235.05

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。

九、基金的业绩

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代表其未来表现。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交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2012年8月9日至2012年12月31日	3.37%	0.54%	12.03%	0.89%	–8.66%	–0.35%
2013年1月1日至2013年12月31日	1.40%	0.95%	–0.26%	0.98%	1.66%	–0.03%
2014年1月1日至2014年6月30日	1.70%	0.87%	0.46%	0.87%	1.24%	0.00%

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号通泰大厦B座12层
设立日期：1998年4月9日
法定代表人：杨明辉
联系人：崔雁巍
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%
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%
南方工业资产管理有限责任公司	7.8%
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、代总经理、党委书记，中信证券股份有限公司党委委员，硕士，高级经济师。兼任华夏资本管理有限公司董事长。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，中国建银投资证券有限责任公司党委副书记、执行董事、总裁，兼任信诚基金管理有限公司董事长等。

杨一夫先生：董事，硕士。现任鲍尔太平有限公司总裁，负责总部加拿大鲍尔公司在中国的投资活动，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）驻中国的首席代表等。

胡祖六先生：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。

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委员、董事总经理、经纪业务发展与管理委员会主任委员、研究部行政负责人，兼任中信证券（山东）、中信期货、前海股权交易中心、青岛蓝海股权交易中心、厦门两岸股权交易中心等公司董事。曾任中国地质机械仪器工业总公司干部，曾任职于中信证券股份有限公司研究咨询部、资产管理部、金融产品开发小组、金融组、研究部、股票销售交易部，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委员、董事总经理、计划财务部行政负责人，兼任华夏资本管理有限公司董事。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（现交易与衍生产品业务部）行政负责人。

朱武祥先生：独立董事，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、系副主任，兼任北京建设（香港上市）及华夏幸福基业、中海油海洋工程、荣信三家内地上市公司的独立董事，中国金融学会常务理事。

贾建平先生：独立董事，大学本科，高级经济师。现已退休。兼任东莞银行独立董事。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处长、处长，中国银行卢森堡公司副总经理，中国银行意大利代表处首席代表，中银集团投资管理公司副董事长、总经理，中国银行重组上市办公室、董事会秘书办公室、上市办公室总经理，中银基金管理有限公司董事长。

谢德仁先生：独立董事，博士，教授。现任清华大学经济管理学院会计学教授、博士生导师，兼任同方环境股份有限公司、北京双杰电气股份有限公司、博彦科技股份有限公司（上市公司）、朗新科技股份有限公司独立董事，中国会计学会财务成本分会第七届理事会副会长。曾任清华大学经济管理学院会计学讲师、副教授。

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、投资决策委员会主席，硕士。曾任公司总经理助理等。

张霄岭先生：副总经理，博士。现兼任上海高级金融学院客座教授、青华大学五道口金融学院特聘教授。曾任中国技术进出口总公司项目经理、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、中国银监会银行监管三部副主任等。

汤晓东先生：督察长，硕士。曾任职于摩根大通、荷兰银行、苏格兰皇家银行、中国证监会等。

李红源先生：监事长，硕士，研究员级高级工程师。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局职员、主任科员、规划处副处长、计划处处长，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、资本运营部巡视员兼副主任。

罗楚良先生：监事，硕士，高级工程师。现任山东省农村经济开发投资公司总经理（法定代表人）、党委副书记，兼任山东高速投资控股有限公司法定代表人、总经理，山东高速环球融资租赁有限公司法定代表人、执行董事兼总经理，山东高速路桥集团股份有限公司董事。曾任山东省交通厅政策法规处副主任科员、主任科员，山东省交通厅外事外经处副处长，山东基建股份有限公司董事、副总经理，山东高速股份有限公司董事、常务副总经理。

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

康茜女士：监事，法学和金融学双学士。现任华夏基金管理有限公司纪律检查委员会委员、法律监察部总经理，兼任华夏资本管理有限公司常务副总经理。曾任中国工商银行北京分行法律部、证券监管部门主任科员，华夏基金管理有限公司成都分公司总经理。

刘文灿先生：监事，工商管理硕士。现任华夏基金管理有限公司法律监察部总监。曾任原北京市二商局干部，中国国际贸易促进委员会干部，华夏基金管理有限公司财务部总经理、办公室主任、稽核总监、人力资源总监等。

王芬华女士：监事，经济学学士。现任华夏基金管理有限公司人力资源部副总经理。曾任北京NTT DATA人力资源部职员，华夏基金管理有限公司人力资源部总经理助理等。

2、本基金基金经理

王路先生，博士。曾任美国纽约德意志资产管理公司基金经理及定量股票研究负责人、美国纽约法兴银行组合经理、大成基金国际业务部副总监等。2008年11月加入华夏基金管理有限公司，现任数量投资部总经理，恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2012年8月9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（2012年8月21日起任职）、上证原材料交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013年3月28日起任职）、上证主要消费交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013年3月28日起任职）、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3月28日起任职）。

张弘弢先生，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联接基金基金经理（2009年7月10日起任职）、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2012年8月9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（2012年8月21日起任职）、华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2012年12月25起任职）、上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013年3月28日起任职）、上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013年3月28日起任职）。

3、本公司国际投资决策委员会成员

主任：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。

成员：林浩先生，华夏基金管理有限公司副总经理。

刘鲁旦先生，华夏基金管理有限公司固定收益总监，华夏海外收益债券型证券投资基金基金经理、年金投资经理。

列席人员：汤晓东先生，华夏基金管理有限公司督察长。

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与支付外币相关的汇兑损益、手续费、汇款费等）。

（4）基金上市初费及年费。

（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等）。

（6）基金合同生效以后的信息披露费用。

（7）基金份额持有人大会费用。

（8）基金合同生效以后的会计师费和律师费。

（9）基金的资金汇划费用。

（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）与基金缴纳税收有关的手续费、汇款费等。

（13）其他为基金的利益而产生的费用，如代表基金投票产生的费用、与基金有关的诉讼费、追索费等。

（14）按照国家有关规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，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在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为前一日的基金资产净值

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）标的指数许可使用费

基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与指数许可方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为前一日的基金资产净值。

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不低于指数使用许可协议规定的下限。

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中披露基金最新适用的方法。

（4）本条第（一）款第1项（4）至（14）小项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入或摊入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目

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。

4、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，无须召开基金份额持有人大会。

（二）申购和赎回的对价、费用及其用途

1、申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的现金替代、现金差额及其他对价。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投资者申购、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，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

3、T日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数。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：人民币贰仟柒佰玖拾叁亿陆仟肆佰陆拾万陆仟叁佰叁拾元整
法定代表人：田国立
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]24号
托管业务部总经理：李爱华
托管部门信息披露联系人：王永民
客服电话：95566
传真：010-66594942

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构银行间债券、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管产品体系。在国内，中国银行是首家开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至2014年6月30日，中国银行已托管276只证券投资基金，其中境内基金251只，QDII基金25只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

十三、境外资产托管人

（一）境外资产托管人基本情况

名称：中国银行（香港）有限公司（简称“中银香港”）
注册地址：香港花园道1号中银大厦
办公地址：香港花园道1号中银大厦
法定代表人：和广北
成立时间：1964年10月16日
组织形式：股份有限公司
存续期间：持续经营

截至2013年12月31日，中银香港的总资产为2,541.5亿美元，资本总额为190.9亿美元，其中实收资本为55.2亿美元，资本充足率16.8%。中银香港最新信用评级如下（截至2012年12月31日）：

	穆迪投资服务	标准普尔	惠誉国际评级
评级展望	稳定	稳定	稳定
长期	Aa3	A+	A
短期	P-1	A-1	F1
基本实力/财务实力	C+	–	–

截至2013年12日31日止，中银香港（控股）有限公司的托管资产规模为6,896亿港元。

（二）境外资产托管人职责

1、安全保管基金的境外资产，及时办理清算、交割事宜。

2、准时将公司行为信息通知基金管理人和/或基金托管人，确保基金及时收取所有应得收入。

3、其他由基金托管人委托其履行的职责。

十四、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、场内申购赎回代理机构：

（1）国泰君安证券股份有限公司
住所：上海市浦东新区商城路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29楼
法定代表人：万建华
电话：021-38676161
传真：021-38670161
联系人：芮敏祺
网址：www.gtja.com
客户服务电话：400-888-8666

（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：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：王常青
客户服务电话：400-888-8108
传真：010-65182261
联系人：权唐
网址：www.csc.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：0755-82133952
联系人：齐晓燕
网址：www.guosen.com.cn
客户服务电话：95536

（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：宫少林
电话：0755-82943666
传真：0755-82943636
联系人：黄健
网址：www.newone.com.cn
客户服务电话：400-888-8111、95565

（5）中信证券股份有限公司
住所：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
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：王东明
电话：010-60833722
传真：010-60833739
联系人：陈忠
网址：www.cs.ecitic.com
客户服务电话：95548

（6）中国银河证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街35号2-6层
办公地址：北京市西城区金融大街35号2-6层
法定代表人：陈有安
电话：010-66568430
传真：010-66568990
联系人：田薇
网址：www.chinastock.com.cn
客户服务电话：400-888-8888

（7）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：上海市黄浦区广东路689号10楼
法定代表人：王开国
电话：021-23219000
传真：021-63410456
联系人：金芸、李笑鸣
网址：www.htsec.com
客户服务电话：021-962503、400-888-8001或拨打各城市营业网点咨询电话

（8）申银万国证券股份有限公司
住所：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层
法定代表人：储晓明
电话：021-54041654
传真：021-54033888
联系人：李清怡
网址：www.sywg.com
客户服务电话：95523、400-889-5523

（9）兴业证券股份有限公司
住所：福州市湖东路268号
办公地址：上海市浦东民生路1199弄五道口广场1号楼21层
法定代表人：兰荣
电话：021-38565785
传真：021-38565955
联系人：谢高得
网址：www.xyzq.com.cn
客户服务电话：95562

（10）中信证券（浙江）有限责任公司
住所：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
办公地址：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
法定代表人：沈强
电话：0571-85783737
传真：0571-85106383
联系人：李珊
网址：www.bigsun.com.cn
客户服务电话：95548

（11）华泰证券股份有限公司
住所：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址：深圳市深南大道4011号港中旅大厦24楼
法定代表人：吴万善
电话：0755-82492193
传真：025-51863323（南京）、0755-82492962（深圳）
联系人：庞晓芸
网址：www.htsc.com.cn
客户服务电话：95597

（12）中信证券（山东）有限责任公司
住所：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
办公地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
法定代表人：杨宝林
电话：0532-85022326
传真：0532-85022605
联系人：吴忠超
网址：www.citicssd.com
客户服务电话：95548

（13）东吴证券股份有限公司
住所：苏州工业园区翠园路181号
办公地址：苏州工业园区星阳街5号
法定代表人：吴永敏
电话：0512-65581136
传真：0512-65588021
联系人：方晓丹
网址：www.dwzq.com.cn
客户服务电话：0512-33396288

（14）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：唐静
网址：www.cindasc.com
客户服务电话：400-800-8899

（15）东方证券股份有限公司
住所：上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层
办公地址：上海市中山南路318号2号楼21层-23层、25层-29层
法定代表人：潘鑫军
电话：021-63325888
传真：021-63326729
联系人：胡月茹
网址：www.dfzq.com.cn
客户服务电话：95503

（16）长城证券有限责任公司
住所：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：黄耀华
电话：0755-83516089
传真：0755-83515567
联系人：李春芳
网址：www.cgws.com
客户服务电话：400-666-6888、0755-33680000

（17）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

（18）中国国际金融有限公司
住所：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人：金立群
电话：010-65051166
传真：010-65058065
联系人：罗春蓉、武明明
网址：www.cicc.com.cn
客户服务电话：010-65051166

（19）北京高华证券有限责任公司
住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际中心1801-1806、1826-1832室
办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际中心1801-1806、1826-1832室
法定代表人：章星
电话：010-66273062、010-66273061
传真：010-66273001
联系人：赵可、葛恒倬
网址：www.ghsl.cn
客户服务电话：400-888-1988

2、二级市场交易代理券商

具有深圳证券交易所会员资格的所有证券公司。

3、基金管理人可根据有关法律法规，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）登记结算机构

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：丁志勇
电话：0755-25941405
传真：0755-25987133

（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：王立华
联系电话：010-57763888
传真：010-57763777
联系人：杨科
经办律师：吴冠雄、杨科

（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：杨绍信
联系电话：021-23238888
传真：021-23238800
联系人：许康玮、洪磊
经办注册会计师：许康玮、洪磊

十五、对招募说明书更新部分的说明

恒生交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他法律法规的要求，对本基金管理人于2014年3月25日刊登的本基金招募说明书（更新）进行了更新，主要更新内容如下：

（一）更新了“四、基金的投资”中的投资组合报告，该部分内容均按有关规定编制。

（二）更新了“五、基金的业绩”，该部分内容均按有关规定编制，并经托管人复核。

（三）更新了“六、基金管理人”中相关内容。

（四）更新了“十、基金份额的申购与赎回”中申购赎回清单的格式举例。

（五）更新了“十八、基金托管