

华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新的招募说明书摘要

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
二〇一五年三月
重要提示

本基金于2014年4月2日经中国证监会管理委员会《证监许可[2014]347号》注册,进行募集。本基金的基金合同自2014年8月12日正式生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书已经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表示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。

投资有风险,投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,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基金合同的当事人,其持有基金份额的行为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。基金管理人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。

基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

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。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在参与投资本基金后,基金营运状况与基金净值变化均以基金的收益或损失由投资人自行负责。

本招募说明书摘要中涉及与基金管理人相关的基金信息已经与基金托管人复核。除特别说明外,本招募说明书所载内容截止日为2014年12月31日。

一、基金的名称

本基金名称:华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

二、基金的类型

本基金为ETF联接基金。运作方式为契约型开放式,存续期限不定期。

三、基金的投资目标

通过投资于目标ETF,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

本基金主要投资于目标ETF、境外交易的跟踪同一标的指数的公募基金、德国DAX指数成份股及备选成份股、跟踪德国DAX指数的股票型基金、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金投资于目标ETF基金的比例不低于基金资产净值的90%(已申购但尚未确认的目标ETF份额可计在内),投资于现金或者到期日在一年以内(含一年)的货币市场工具不高于基金资产净值的5%。

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,可以相应将其纳入本基金的投资范围,但法律法规或中国证监会允许投资品种的比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可相应调整投资比例限制,不需经基金份额持有人大会审议。

五、基金的投资策略

(一) 投资策略

本基金为目标ETF的联接基金,目标ETF是采用完全复制法实现对标的指数拟合程度的全被动指数基金。

本基金通过投资全部或接近全部的基金资产投资于目标ETF,标的指数成份股和备选成份股通过被动指数化投资,实现对业绩比较基准的紧密跟踪,正常情况下,本基金投资于目标ETF的比例不低于本基金资产净值的90%,且跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

本基金投资于目标ETF的方式以申购和赎回为主,但在目标ETF二级市场流动性较好的情况下,为了更好地实现本基金的投资目标,减小与标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差,也可以通过二级市场交易买卖目标ETF。本基金在目标ETF上市前,可通过特殊申购的方式完成对目标ETF的申购。

为了更好地对外币资金进行投资管理,本基金还可以与目标ETF或其他QDII基金进行。

外汇互换,互换价格需遵循公平、合理的原则以及监管机构的相关规定。

(二) 投资限制

1. 禁售行为

为维护基金份额持有人的合法权益,除中国证监会另有规定外,本基金禁止从事下列行为:

(1) 承销证券;

(2) 违反规定向他人贷款或提供担保;

(3) 从事承担无限责任的投资;

(4) 购买不动产;

(5) 购买房地产抵押按揭;

(6) 购买贵金属或代表贵金属的凭证;

(7) 购买实物商品;

(8) 除应付赎回、交易清算等临时用途以外,借入现金;

(9) 利用融资融券交易,但投资金融衍生品除外;

(10) 参与未持有基本权益的证券交易;

(11) 购买证券用于控制或影响该证券的机构或其管理人;

(12) 直接投资与实物商品相关的衍生品;

(13) 向基金管理人、基金托管人支付费用;

(14) 从事内幕交易,操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动;

(15) 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,基金管理人在履行适当程序后可不受上述限制。

除法律法规和监管部门禁止,本基金可以投资境外托管人发行的金融产品。

2. 投资组合限制

(1) 基金持有一家同一银行的存款不得超过基金资产净值的20%。本款所称银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行,但在基金托管账户的存款可以不受上述限制。

(2) 基金持有一家境外基金的市值合计不得超过基金净值的10%。持有货币市场基金可以不受前述限制。

(3) 基金管理人管理的全部基金持有一只境外基金,不得超过基金总资产的20%。

(4) 为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的10%,临时借入现金的期限以中国证监会规定的期限为准。

(5) 法律法规及中国证监会规定的其他投资限制。

3. 金融衍生品投资

本基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理,不得用于投机或放大交易,同时应当严守遵守下列规定:

(1) 基金的衍生品全部敞口不得超过基金资产净值的100%。

(2) 基金投资衍生品的初始保证金、投资期权支付的期权费、投资组合交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的10%。

(3) 基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品,应当符合以下要求:

1) 所有参与交易的对手方(中资商业银行除外)应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级。

2) 交易对手方应当至少每一个工作日对交易进行估值,并且基金可在任何时候以公允价值终止交易。

3) 任一交易对手的市价计价敞口不得超过基金资产净值的20%。

(4) 基金投资衍生品,基金管理人在产品募集申请中应当向中国证监会提交基金投资衍生品的基金管理规则、流程、拟采用的组合避险、有效管理策略。

(5) 基金管理人应当在基金会计年度结束后60个工作日内向中国证监会提交包含衍生品头寸及风险分析的年度报告。

4. 关于投资标的限制

(1) 每只境外基金的投资比例不超过本基金基金资产净值的20%。本基金投资境外基金的,该基金应当视为一只基金。

(2) 本基金不投资于以下基金:

1) 其他基金中基金;

2) 联接基金(A-Feeder Fund);

3) 投资于前述两类基金的伞型基金基金。

5. 本基金可以参与境外基金借贷交易,并且应当遵守下列规定:

(1) 所有参与交易的对手方(中资商业银行除外)应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

(2) 当地采取市价计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的10%。

(3) 债券应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦债券违约,本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

(4) 除中国证监会另有规定外,担保物可以是以下金融工具或品种:

1) 现金;

2) 存款证明;

3) 商业票据;

4) 政府债券;

5) 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构(作为交易对手方或其关联方的除外)出具的不可撤销信用证。

(5) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求偿还或所有已借出的证券的借贷。

(6) 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

6. 基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易,并且应当遵守下列规定:

(1) 所有参与交易的对手方(中资商业银行除外)应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

(2) 当地采取市价计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的10%。

(3) 债券应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦债券违约,本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

(4) 除中国证监会另有规定外,担保物可以是以下金融工具或品种:

1) 现金;

2) 存款证明;

3) 商业票据;

4) 政府债券;

5) 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构(作为交易对手方或其关联方的除外)出具的不可撤销信用证。

(5) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求偿还或所有已借出的证券的借贷。

(6) 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

7. 基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易,并且应当遵守下列规定:

(1) 所有参与交易的对手方(中资商业银行除外)应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

(2) 当地采取市价计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的10%。

(3) 债券应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦债券违约,本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

(4) 除中国证监会另有规定外,担保物可以是以下金融工具或品种:

1) 现金;

2) 存款证明;

3) 商业票据;

4) 政府债券;

5) 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构(作为交易对手方或其关联方的除外)出具的不可撤销信用证。

(5) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求偿还或所有已借出的证券的借贷。

(6) 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

8. 基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易,并且应当遵守下列规定:

(1) 所有参与交易的对手方(中资商业银行除外)应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

(2) 当地采取市价计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的10%。

(3) 债券应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦债券违约,本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

(4) 除中国证监会另有规定外,担保物可以是以下金融工具或品种:

1) 现金;

2) 存款证明;

3) 商业票据;

4) 政府债券;

5) 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构(作为交易对手方或其关联方的除外)出具的不可撤销信用证。

(5) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求偿还或所有已借出的证券的借贷。

(6) 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

9. 基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易,并且应当遵守下列规定:

(1) 所有参与交易的对手方(中资商业银行除外)应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

(2) 当地采取市价计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的10%。

(3) 债券应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦债券违约,本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

(4) 除中国证监会另有规定外,担保物可以是以下金融工具或品种:

1) 现金;

2) 存款证明;

3) 商业票据;

4) 政府债券;

5) 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构(作为交易对手方或其关联方的除外)出具的不可撤销信用证。

(5) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求偿还或所有已借出的证券的借贷。

(6) 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

10. 基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易,并且应当遵守下列规定:

(1) 所有参与交易的对手方(中资商业银行除外)应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

(2) 当地采取市价计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的10%。

(3) 债券应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦债券违约,本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

(4) 除中国证监会另有规定外,担保物可以是以下金融工具或品种:

1) 现金;