

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

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

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
二〇一五年九月

重要提示
本基金经中国证监会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]1823号)和2012年6月28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8月9日正式生效。

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,并接受《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。本招募说明书经中国证监会备案,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。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。

本基金投资于标的指数成份股,备选成份股资产不低于基金资产净值的95%。本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资有风险,投资者在投资本基金前,请认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,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、数量等投资行为作出独立决策,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、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数的波动风险、基金投资组合回报与标的指数的跟踪偏离风险、基金管理人代理申购赎回业务引发的风险、基金价格波动风险、基金估值风险、基金申购赎回失败的风险、赎回失败的风险、投资者参与OPV赎回投资资金的风险和OPV计算误差的风险、第三方机构服务的风险、管理风险、创新风险等;(2)投资股票,主要包括市场风险等;(3)运作风险,主要包括操作风险等;(4)不可抗力风险;等等。本基金股票投资指数基金,预期收益与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金跟踪香港市场股票资产,基金净值会因香港证券市场波动等因素而产生波动,同时面临汇率风险等投资境外市场的特殊风险。

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,由投资者自行承担。基金管理人、基金托管人、基金销售机构独立管理,不承担连带保证责任。基金的过往业绩并不预示其未来业绩表现。

在目标申购赎回时,投资者当日申购的基金份额,清算交收完成后方可卖出赎回,即T日申购的基金份额,T+1日交收成功后T+2日可卖出赎回。当T日买入的基金份额,同日可以赎回或卖出。由于登记结算机构对现金替代采取非净额结算交收模式,当投资者赎回申请被登记结算机构确认后,被赎回的基金份额即被记减,但此时投资者尚未收到赎回现金替代。投资者投资本基金时须具有证券账户,证券账户是指上海证券交易所A股账户或上海证券交易所证券投资基金账户。

本基金份额的申购、赎回或赎回本基金,即表示对基金认购、申购和赎回所涉及的基金份额的证券变更登记方式以及申购赎回所涉及现金替代的交收方式已认可并确认。

本招募说明书已经本基金管理人复核。除非另有说明,本招募说明书所载内容截止日为2015年6月30日,有关财务数据截止日为2015年6月30日,净值表现截止日为2015年6月30日。(本报告中财务数据未经审计)

易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金
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的最小化。

本基金投资于标的指数的成份股,备选成份股、境外交易的跟踪同一标的指数的公募基金、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和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和中国证监会要求履行相关手续后,还可以投资于法律法规和中国证监会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。

基金投资标的指数的成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的95%。

本基金股票投资指数基金,预期收益与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。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市的中国企业股,需承担汇率风险以及境外市场的风险。

本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,由投资者自行承担。基金管理人、基金托管人、基金销售机构独立管理,不承担连带保证责任。基金的过往业绩并不预示其未来业绩表现。

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,复核了本报告的内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本投资组合报告有关数据的期间为2015年4月1日至2015年6月30日。

	其中:权益投资	4,792,391,797.92	96.08
1	存托凭证	—	—
	基金投资	—	—
2	固定收益投资	—	—
	其中:债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	金融衍生工具投资	—	—
	其中:远期	—	—
	期货	—	—
	期权	—	—
	权证	—	—
5	买入返售金融资产 ²⁶	—	—
	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	66,314,980.74	1.33
8	其他各项资产 ²⁶	129,362,931.70	2.59
9	合计	4,989,669,659.26	100.00

注:上表中的普通股权投资项可替代款估值增值,而2和3的合计项不可替代款估值增值。

2. 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证资产分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
香港	4,792,391,797.92	96.08
合计	4,792,391,797.92	96.08

注:1.国家(地区)类别根据其所在的证券市场确定。
2.ADR、GDR按照托托存托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

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)	
农林牧渔	660,377,422.06	13.36	
医药	126,396,197.12	2.58	
工业	112,396,174.88	2.33	
必需消费品	169,529,327.07	3.47	
可选消费品	26,156,080.14	0.52	
金融	60,790,264.31	1.26	
能源	3,275,540,852.01	69.37	
信息技术	-	-	-
电信服务	93,414,060.07	1.92	
公共事业	100,285,013.06	2.09	
合计	4,792,391,797.92	96.08	

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

4. 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	Bank of China Ltd.	中国银行股份有限公司	3980 HK	126,815,000	10.36
2	China Construction Bank Co., Ltd.	中国建筑股份有限公司	930 HK	45,138,260.52	3.76
3	Industrial & Commercial Bank of China Ltd.	中国工商银行股份有限公司	1308 HK	97,048,000	7.97
4	Ping An Insurance Group Co., Ltd.	中国平安保险(集团)股份有限公司	2318 HK	4,091,000	0.33
5	China Life Insurance Co., Ltd.	中国人寿保险股份有限公司	2658 HK	13,062,000	1.07
6	PetroChina Co., Ltd.	中国石油天然气股份有限公司	857 HK	39,588,000	3.26
7	China Petroleum & Chemical Corp.	中国石化股份有限公司	386 HK	46,487,200	3.83
8	China Merchants Bank Co., Ltd.	招商银行股份有限公司	3908 HK	8,613,546	0.71
9	Agricultural Bank of China Ltd.	中国农业银行股份有限公司	1288 HK	46,134,000	3.82
10	China Pacific Insurance Group Co., Ltd.	中国太平洋保险(集团)股份有限公司	2601 HK	4,683,800	0.38

注:此处理用证券代码的类别是指市场代码。

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十名债券投资

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债券投资

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名资产支持证券投资

8. 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

9. 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

10. 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

11. 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

12. 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

13. 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

14. 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

15. 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

16. 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

17. 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

18. 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

19. 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

20. 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

21. 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

22. 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

23. 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

24. 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

25. 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

26. 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

27. 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

28. 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

29. 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

30. 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

31. 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

32. 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

33. 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

34. 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

35. 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

36. 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

37. 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

38. 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

39. 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

40. 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

41. 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

42. 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

43. 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

44. 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

45. 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

46. 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

47. 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

48. 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

49. 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

50. 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

51. 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

52. 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

53. 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

54. 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

55. 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

56. 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

57. 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

58. 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

59. 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

60. 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

61. 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

62. 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

63. 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

64. 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

65. 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

66. 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

67. 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

68. 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

69. 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

70. 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

71. 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

72. 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

73. 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

74. 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

75. 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

76. 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

77. 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

78. 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

79. 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

80. 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

81. 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

82. 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

83. 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

84. 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

85. 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

86. 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

87. 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

88. 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

89. 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

90. 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

91. 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

92. 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

93. 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

94. 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

95. 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

96. 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

97. 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

98. 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

99. 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

100. 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

101. 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

102. 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

103. 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

104. 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

105. 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

106. 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

107. 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

108. 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

109. 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

110. 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

111. 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

112. 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

113. 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

114. 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

115. 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

116. 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

117. 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

118. 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

119. 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

120. 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

121. 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

122. 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

123. 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

124. 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

125. 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

126. 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

127. 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

128. 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

129. 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

130. 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

131. 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

132. 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

133. 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

134. 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

135. 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

136. 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

137. 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

138. 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

139. 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

140. 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

141. 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