易方达恒生中国企业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: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
二〇一六年四月

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】823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时间安排的确认函》(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8月21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。基金投资人除了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

基金管理人保证投资资产的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,中国证监会对本基金募集的批准,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资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本基金为易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金(以下简称易方达恒生中国企业ETF)的联接基金,其投资目标是紧密跟踪业绩比较基准,也求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。本基金投产中投资于易方达恒生中国企业ETF的比例不低于基金资产净值的90%。本基金投资于证券期货市场,基金净值会因为证券期货市场波动等因素产生波动,投资者风险,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主要风险包括:(1)本基金特有的风险,主要包括指数波动的风险、指数编制机构改变指数编制规则风险、基金收益率与业绩比较基准收益率偏离的风险、基金开通外汇从中银业务带来的风险等;(2)投资风险,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。如果投外投资市场的货币相对于人民币贬值,将对基金收益产生不利影响;此外,外币对人民币的汇率大幅波动也可能加大人民币份额基金净值波动的幅度;由于本基金外币份额的净值计算与汇率挂钩,外币对人民币的汇率大幅波动也可能加大外币份额净值波动的幅度。本基金是ETF联接基金,理论上其风险收益水平高于混合型基金,债券基金和货币市场基金。

本招募说明书已经本基金托管人复核。除非另有说明,本招募说明书所载内容截止日为2016年2月21日,有关财务数据截止日为2015年12月31日,净值表现截止日为2015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联接基金

二、基金的类型

本基金为契约型、开放式、境外指数基金、联接基金

三、基金的投资目标

紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

四、基金的投资方向

本基金将产权资于具有良好流动性的金融工具,包括目标ETF,境外交易的跟踪同一标的指数的公募基金、恒生中国企业指数成份股及基选成份股、跟踪恒生中国企业指数的股指期货等金融衍生品、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未来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届时最新规定,还可以投资于法律法规或中国证监会未来允许基金投资的其它金融工具,但是符合中国证监会的相关规定。

本基金投产中投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%,投资本基金时期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

五、基金的投资策略

本基金为易方达恒生中国企业ETF的联接基金,主要通过投资于易方达恒生中国企业ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。

在易方达恒生中国企业ETF上市时,本基金将通过转换现金申购方式进行易方达恒生中国企业ETF的投资,在易方达恒生中国企业ETF上市后,本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上,决定采用申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行易方达恒生中国企业ETF的投资。

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,本基金可投资恒生中国企业指数成份股及备选成份股、恒生中国企业指数期货或期权等金融衍生工具。

本基金力争将年化跟踪误差控制在4%以内。

六、基金的业绩比较基准

恒生中国企业指数(使用价值汇率折算)收益率X95%+活期存款利率(税后)X5%

七、基金的风险收益特征

本基金是ETF联接基金,理论上其风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。

本基金主要通过投资于易方达恒生中国企业ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此,本基金的业绩表现与恒生中国企业指数的表现密切相关。此外,本基金通过主要投资于易方达恒生中国企业ETF间接投资于香港证券市场,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个别及连带责任。

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,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10月1日至2015年12月31日。

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	–	–
	其中:普通股	–	–
	存托凭证	–	–
	优先股	–	–
	房地产信托	–	–
2	基金投资	1,121,631,715.41	93.01
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	74,212,664.92	6.15
8	其他资产	10,029,803.72	0.83
9	合计	1,205,874,184.05	100.00

2、期末按登记标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式(ETF)	易方达基金管理有限公司	1,121,631,715.41	93.60

3.按所属未各个国家(地区)或各市场的股票发存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

4.按所属未按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.按所属未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

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

6.按所属未按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.按所属未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。

8.按所属未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。

9.按所属未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

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

10.按所属未股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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式(ETF)	易方达基金管理有限公司	1,121,631,715.41	93.60

11.投资组合报告附注

(1)本基金投资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。

(3)其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	376,936.80
2	应收证券清算款	4,811,778.26
3	应收股利	–
4	应收利息	12,318.03
5	应收申购款	921,116.13
6	其他应收款	3,907,655.50
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	10,029,803.72

(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在有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的说明。

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资产,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,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为2012年8月21日,基金合同生效以来(截至2015年12月31日)的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示:

阶段	净值增长率①	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
基金合同生效至2012年12月31日	7.68%	0.61%	14.89%	1.17%	-7.21%	-0.56%
2013年1月1日至2013年12月31日	-6.85%	1.28%	-7.78%	1.35%	0.93%	-0.07%
2014年1月1日至2014年12月31日	12.66%	1.10%	10.70%	1.13%	1.96%	-0.03%
2015年1月1日至2015年12月31日	-14.48%	1.64%	-13.55%	1.73%	-0.93%	-0.09%
基金合同生效至2015年12月31日	-3.36%	1.30%	1.39%	1.40%	-4.75%	-0.10%

注:1.同期业绩比较基准已经换为以人民币计价。

2.上述净值表现数据按照《证券投资基金信息披露编报规则第2号-基金净值表现的编制及披露》的相关规定编制。

十、基金管理人

(一)基金管理人基本情况

1.基金管理人:易方达基金管理有限公司

注册地址:广东省珠海市横琴新区宝华路3号4004-8室

办公地址:广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼

设立日期:2001年4月17日

法定代表人:刘晓艳

联系电话:400 881 8088

联系人:贺贤

注册资本:12,000万元人民币

2.股权结构

股东名称	出资比例
广东粤财信托有限公司	1/4
广发证券股份有限公司	1/4
盈峰投资控股集团有限公司	1/4
广东省广晟资产经营有限公司	1/6
广州市广水国有资产经营有限公司	1/12
总 计	100%

(二)主要人员情况

1.董事、监事及高级管理人员

叶俊英先生,经济学博士,董事长。曾任中国南海石油联合服务总公司条法国科员、副科长、科长,广东省烟草专卖局专卖办公室干部,广发证券有限责任公司投资银行部总经理、公司董事、副总裁,易方达基金管理有限公司总裁、董事、副董事长。现任易方达基金管理有限公司董事长,易方达国际控股有限公司董事长。

刘晓艳女士,经济学博士,副董事长、总裁。曾任广发证券有限责任公司投资理财部副总经理,基金经理,基金投资理财部副总经理,基金管理有限公司副董事长、总裁,易方达基金管理有限公司督察员,监察部总经理,市场部总经理,总裁助理,公司副总裁,常务副总裁、董事,现任易方达基金管理有限公司副董事长、总裁,易方达国际控股有限公司董事长。

秦力先生,经济学博士,董事。曾任广发证券投资银行部常务副总经理,投资理财部总经理,资金管运部总经理,规划管理部总经理,投资自营部总经理,公司总经理助理,副总经理。现任广发证券投资有限公司董事、常务副总经理,广发控股(香港)有限公司董事,广东金融高新区投资有限公司董事、有限公司董事长。

杨力先生,高级管理人员工商管理硕士(EMBA),董事。曾任美的集团空调事业部战术主管、企划经理,佛山顺德百年科技有限公司行政总监,美的空调深圳营销中心区域经理,佛山顺德创佳电器有限公司董事,副总经理,长虹空调广州营销中心营销总监,广东盈峰投资控股集团有限公司战略总监、董事、副总裁。现任盈峰投资控股集团有限公司董事,盈峰专用设备有限公司总经理。

刘东辉先生,管理学博士,董事。曾任广州市东建实业总公司发展规划处计划员,广州商贸中心(马美西亚)有限公司副总经理,董事总经理,广州东建南洋经贸发展有限公司董事总经理,广东粤财信托有限公司综合管理部副总经理,信托管理三部副总经理,总经理助理,现任广东粤财信托有限公司副总经理,信托管理二部总经理。

郑毓光先生,经济学硕士,董事,曾任湖南证券发行部经理助理,湖财证券投资银行总部经理助理,财富证券投资银行总部经理助理,万家宏观经济研究所研究员,万家证券投资银行总部经理,现任广东证券投资有限公司投资经理助理,东证管理董事,广东粤财信托有限公司董事,佛山市国星光电股份有限公司董事,深圳市中金岭南有色金属股份有限公司监事,新潮照明股份有限公司董事。

王化成先生,经济学博士,独立董事。曾任中国人民大学商学院教授,讲师、副教授,现任中国人民大学商学院教授,博士生导师。

何小锋先生,经济学硕士,独立董事。曾任广东东软学院教育培训部主任,中共广东省委党校学员班主任,北京大学经济学院讲师、副教授,金融系主任。现任北京大学经济学院教授,博士生导师。

朱征夫先生,法学博士,独立董事。曾任广东经济贸易律师事务所金融业务部广部主任,广东大陆律师事务所合伙人,广东省国土厅广东地产法律咨询服务中心副主任。现任广东东方投仓律师事务所主任。

陈国祥先生,经济学硕士,独事会主席,曾任交通银行广州分行江南西营业部经理,广东粤财信托投资公司证券部副总经理,基金部总经理,易方达基金管理有限公司市场拓展部总经理,总裁助理,市场总监,现任易方达基金管理有限公司监事会主席。

李勤全先生,经济学硕士,独事,曾任东海证券投资咨询部经理,中国证监会广州证管办处长,广州市广永国有资产经营有限公司董事长,广州投权交易中心有限公司董事长,立信融资租赁有限公司董事长。现任广州金融控股集团有限公司副董事长、总经理,万联证券有限责任公司董事长,广州银行董事长,广州汽车集团股份有限公司独立董事,广州金控资本管理有限公司董事长,广州中嘉(三明)基金管理有限公司董事长,广东期货有限公司董事,广州立根小额再贷款股份有限公司董事长。

廖辉先生,经济学硕士,独事,曾任广东证券股份有限公司基金部主管,易方达基金管理有限公司综合管理部副总经理,人力资源部副总经理,市场部总经理,互联网金融部总经理,现任易方达基金管理有限公司总裁助理,新任广东粤财信托有限公司董事。

张钱逸先生,工商管理硕士(MBA),常务副总裁,曾任南方证券交易中心业务发展部经理,广东证券公司发行上市部经理,深圳证券业务部总经理,基金部总经理,易方达基金管理有限公司董事、副总裁。现任易方达基金管理有限公司常务副总裁,易方达资产管理(香港)有限公司董事。

肖坚先生,经济学硕士,副总裁。曾任广东粤财信托投资公司副总,南粤证券股份有限公司证券业务部经理,广东粤财信托投资公司基金部经理,易方达基金管理有限公司投资管理部常务副总经理,易方达资产管理(香港)有限公司董事。

张俊,经济学硕士,副总裁。曾任广东粤财信托投资公司基金部经理,易方达基金管理有限公司证券业务部经理,广东粤财信托投资公司证券部经理,易方达基金管理有限公司投资管理部常务副总经理,易方达资产管理(香港)有限公司董事。

吴杰先生,经济学硕士,副总裁。曾任广东粤财信托投资公司证券部经理,易方达基金管理有限公司证券业务部经理,基金经理,易方达基金管理有限公司投资管理部副总经理,易方达资产管理(香港)有限公司董事。

陈国祥先生,经济学硕士,副董事长兼总经理。曾任交通银行广州分行江南西营业部经理,广东粤财信托投资公司证券部副总经理,基金部总经理,易方达基金管理有限公司市场拓展部总经理,总裁助理,市场总监,现任易方达基金管理有限公司监事会主席。

李勤全先生,经济学硕士,独事,曾任东海证券投资咨询部经理,中国证监会广州证管办处长,广州市广永国有资产经营有限公司董事长,广州投权交易中心有限公司董事长,立信融资租赁有限公司董事长。现任广州金融控股集团有限公司副董事长、总经理,万联证券有限责任公司董事长,广州银行董事长,广州汽车集团股份有限公司独立董事,广州金控资本管理有限公司董事长,广州中嘉(三明)基金管理有限公司董事长,广东期货有限公司董事,广州立根小额再贷款股份有限公司董事长。

廖辉先,经济学硕士,董事,曾任广东证券股份有限公司基金部主管,易方达基金管理有限公司综合管理部副总经理,人力资源部副总经理,市场部总经理,互联网金融部总经理,现任易方达基金管理有限公司总裁助理,新任广东粤财信托有限公司董事。

张钱逸先生,工商管理硕士(MBA),常务副总裁,曾任南方证券交易中心业务发展部经理,广东证券公司发行上市部经理,深圳证券业务部总经理,基金部总经理,易方达基金管理有限公司董事、副总裁。现任易方达基金管理有限公司常务副总裁,易方达资产管理(香港)有限公司董事。

肖坚先生,经济学硕士,副总裁。曾任广东粤财信托投资公司副总,南粤证券股份有限公司证券业务部经理,广东粤财信托投资公司证券部经理,易方达基金管理有限公司投资管理部常务副总经理,易方达资产管理(香港)有限公司董事。

张俊,经济学硕士,副总裁。曾任广东粤财信托投资公司基金部经理,易方达基金管理有限公司证券业务部经理,广东粤财信托投资公司证券部经理,易方达基金管理有限公司投资管理部常务副总经理,易方达资产管理(香港)有限公司董事。

吴杰先生,经济学硕士,副总裁。曾任广东粤财信托投资公司证券部经理,易方达基金管理有限公司证券业务部经理,基金经理,易方达基金管理有限公司投资管理部副总经理,易方达资产管理(香港)有限公司董事。

陈国祥先生,经济学硕士,副董事长兼总经理。曾任交通银行广州分行江南西营业部经理,广东粤财信托投资公司证券部副总经理,基金部总经理,易方达基金管理有限公司市场拓展部总经理,总裁助理,市场总监,现任易方达基金管理有限公司监事会主席。

李勤全先生,经济学硕士,独事,曾任东海证券投资咨询部经理,中国证监会广州证管办处长,广州市广永国有资产经营有限公司董事长,广州投权交易中心有限公司董事长,立信融资租赁有限公司董事长。现任广州金融控股集团有限公司副董事长、总经理,万联证券有限责任公司董事长,广州银行董事长,广州汽车集团股份有限公司独立董事,广州金控资本管理有限公司董事长,广州中嘉(三明)基金管理有限公司董事长,广东期货有限公司董事,广州立根小额再贷款股份有限公司董事长。

廖辉先生,经济学硕士,独