汇添富恒生指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
重要提示

本基金经2013年9月26日中国证券监督管理委员会证监许可【2013】1247号文核准募集。本基金基金合同于2014年3月6日正式生效。

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,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风险,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;由于基金分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,分级份额投资者特有的风险等。(详见招募说明书“风险揭示”章节)。本基金属于股票型基金,其风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。此外,本基金作为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪标的指数市场表现,目标为获取市场平均收益,是投资基金中处于中等风险水平的基金产品。

本基金的分级设定则决定了不同分额具有不同的风险和收益特征。恒生A分额具有低风险、低预期收益的特征;恒生B分额具有高风险、高预期收益的特征。由于本基金投资的恒生指数成分股在香港交易所上市交易,根据香港交易所对于股票价格涨跌幅不设限制的交易规则,添富恒生的份额净值每日涨跌幅不受限制,故本基金的预期风险、预期收益较当前沪深交易所上市交易的普通股票指数型基金更大。特别的,当恒生指数发生日内巨幅下跌,以致恒生份额的参考净值跌至负值的情况下,恒生B份额投资者损失所有本金,剩余亏损由恒生A份额投资者承担,因恒生B份额较基础份额(添富恒生)的风险更大。而基于以上风险条件,具有固定收益特性的恒生A份额既不保证收益也不保证本金不受亏损,风险小于基础份额,高于当前货币证券交易所运行的普通股票型分级证券投资基金的债券型收益份额。

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。

基金的过往业绩并不预示本基金未来表现。

本摘要根据本基金的基金合同和本基金的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。本基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为本基金份额持有人和本基金合同当事人,其持有本基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、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本基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载最止日为2016年9月6日,有关财务数据和净值表现截止日为2016年6月30日,有关基金管理人的内容截止招书公告日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

一、基金名称

汇添富恒生指数分级证券投资基金

二、基金的类别与运作方式

基金类型为股票型证券投资基金,基金运作方式为契约型开放式

三、投资目标

紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

四、投资范围

本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股。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90%。

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、投资策略

(一)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。

1.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。

2.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。

3.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、期权等)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4%。

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。

(二)投资决策机制和程序

1.投资决策依据

(1)国家有关法律、法规和《基金合同》的规定;

(2)标的指数的相关规定;

(3)《汇添富基金管理股份有限公司章程》的有关规定;

(4)《汇添富基金管理股份有限公司投资管理制度》的有关规定。

2.投资决策机制

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

(1)投资决策委员会的主要职能:

本基金管理人设立的投资决策委员会是本基金投资的最高决策机构。投资决策委员会的主要职责包括:

1)负责决定有关指数重大调整的应对决策;

2)负责决定其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策;

3)审核评估基金经理与季报交的投资组合季报。

(2)基金经理的主要职责

基金经理的主要职责包括:

1)决定正常市场情况下,日常指数跟踪过程中的组合构建、调整决策以及日常管理等工作;

2)必要时进行本基金跟踪偏离的分析;

3)每季向投资决策委员会提交本基金的投资运作季报;

4)撰写基金中期报告、年报等公开报告关于基金投资运作的相关部分。

3.投资决策程序

本基金投资程序分为投资研究、投资决策、投资执行(组合构建与监控调整)、交易执行、投资绩效评估、投资报对与监督、组合监控与调整、投资风险管理八个环节。

(1)研究支持

指数投资管理小组依托基金管理人整体研究平台,整合内外部的信息和研究成果,开展对标的指数的跟踪研究、对标的指数成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、对标的指数成份股流动性分析、对基金的跟踪误差及时进行识别分析等工作,并撰写相关研究报告,作为基金投资决策的重要依据。

(2)投资决策

投资决策委员会依据指数投资管理小组提供的研究报告,定期或遇重大事项时召开投资决策会议,决定相关事项。基金经理在投资决策委员会决议的基础上,进行基金投资管理的日常决策。

定期事项是指:每季初投资决策委员会对基金的操作进行指导与决策,基金经理根据公司投资决策委员会的决策开展下一阶段的工作;

(3)投资执行(组合构建与监控调整)

根据标的指数,结合指数投资管理小组的研究报告,基金经理以完全复制标的指数的方法构建组合。在跟踪误差和偏离度最小化的前提下,基金经理将综合考虑成本、流动性、市场冲击等因素,在一定时间内完成组合构建。

(4)交易执行

集中交易室负责具体的交易执行,同时履行一线监控职责。

(5)风险监控:风险控制人员根据定时风险监控系统,在交易时间对指数基金的各类风险源进行监控,一旦发现异常立即通知基金经理,基金经理将根据风险的具体情况,确定相应的应急操作方案。

(6)投资绩效评估

金融工程部定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关报告。绩效评估将确认组合是否实现了投资预期,对跟踪误差和业绩偏离的来源进行分析,基金经理可以据此调整投资策略,调整组合组合。

(7)不定期的,基金经理对基金出现的较大的跟踪偏离进行及时分解和分析;

(8)每周末,数据分析师对本基金的运行情况进行量化评估。

(3)每月末,基金经理根据评估报告分析当月的投资组合和跟踪指数的偏离情况,主要对组合跟踪偏离和跟踪误差、现金控制情况、成份股变动新增的投资操作以及成份股未来可能发生的变化进行分析并提供相关报告,作为今后投资运作的参考依据。

在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制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,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

(7)投资核对与监督

基金管理部根据合计通过交易数据的核对,对当日交易操作进行复核,如发现有违反《证券法》、《证券投资基金法》、《基金合同》、公司相关管理制度的交易操作,须立即向投资总监汇报,并同时通报投资联长、稽核监察部及基金经理。

集中交易室负责对基金投资的日常交易行为进行实时监控。

督察长和稽核监察部对投资决策和投资执行的过程进行合规性监督检查,有权调阅任何数据和资料,防止在投资管理过程中的违规风险。

(8)投资风险管理

投资风险管理是基金投资管理的重要环节,公司根据投资决策的不同层次建立完善的基金风险控制系统。

基金投资风险管理包括对投资合规性的管理以及对投资组合的风险管理。

1)公司风险管理委员会定期不定期对公司投资管理制度、投资决策程序的合法性、合规性、有效性及基金运作过程中的合法性、合规性进行全面检查评价,如发现问题,应责成公司相关部门提出改进方案并落实。

2)风险管理委员会和金融工程部通过审议本基金的投资运作季报,以及对日常投资的跟踪监控,从而控制本基金的投资组合风险。

基金管理人在确保基金价额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整,并在基金招募说明书书及其更新中公告。

(三)投资限制

1.组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金非现金资产的90%;

(2)保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;

(3)本基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的20%,其中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末按照中国证监会认可的应用评级机构评级的境外银行,且该银行最近一个会计年度末评级在投资级以上;

(4)本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的10%,其中持有在一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的3%;

(5)基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的15%;

前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券及中国证监会认定的其他资产。

(6)本基金持有境外基金的市值计不得超过基金资产净值的10%,但持有货币市场基金不受此限制;

(7)同一基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金,不得超过该境外基金总份额的20%;

(8)为应付赎回、交易清算等临时用途持有现金的比例不得超过基金资产净值的10%;

(9)法律法规及中国证监会规定的和本基金合同约定的其他投资限制。

若基金超过上述本条第(2)款规定的限制,应当在超过该限制后,应当在合理的商业期限内采取措施使之符合投资比例限制要求。

基金管理人应当基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制,不需经基金份额持有人大会审议。

2.禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)购买不动产;

(5)购买实物资产抵押权等;

(6)购买贵金属或代表贵金属所有权;

(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)利用融资购买证券,但投资金融衍生品除外;

(10)参与与本特有基础资产的卖空交易;

(11)除应付赎回、交易清算等临时用途以外,将基金财产的现金以拆借或者贷款的方式提供给他人;

(12)直接投资与实物商品相关的衍生品;

(13)向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;

(14)买卖其基金管理人、基金托管人有控股关系的股票或者债券;

(15)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(16)法律法律法规有关规定、由中国证监会规定禁止的其他活动。

对于因上述(13、14)条情形导致无法按投资的标的指数成份股或备选成份股,基金管理人将在严格控制跟踪误差的前提下,将结合使用其他合理方法进行适当操作。

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

3.金融衍生品投资限制

本基金投资衍生品应当仅限于标的指数成份股或备选成份股,不得用于机械或放大交易,同时应当严格遵守下列规定:

(1)本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的100%;

(2)本基金投资期货交易时的初始保证金,投资期权支付或收取的期权费,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)本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:

a.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;

b.交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值,并且基金有在任何时候以公允价值终止交易;

c.任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的20%。

(4)基金管理人应当在本基金合同生效后6个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析在内报告。

4.本基金可以参与券商转交易,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)应当采取市值计价制度进行调整以确保标的市值不低于已借出证券市值的102%;

(3)借方应当在合理期限内将所借入的证券市值的102%以现金或国债、银行存款、银行承兑汇票、银行保函、短期融资券、中期票据、中国证监会接受的其他证券作为担保物,并在交易期间保持担保物的市值不低于应付证券市值的102%。一旦实方违约,本基金有权暂扣担保物以和无法律有权保留或处置实方收益以满足索赔需要;

(4)实方应当在证券交易结束后,将所借入证券及应计收益返还基金的所有权益、利息和分红;

(5)借方应当在合理期限内将所借入证券市值的102%以现金或国债、银行存款、银行承兑汇票、银行保函、短期融资券、中期票据、中国证监会接受的其他证券作为担保物,并在交易期间保持担保物的市值不低于应付证券市值的102%。一旦实方违约,本基金有权暂扣担保物以和无法律有权保留或处置实方收益以满足索赔需要;

(6)基金管理人应当对基金参与证券借贷交易,进行跟踪监控,并在基金管理人中设立专门的风险管理委员会,对基金的借贷交易进行定期评估,并提供相关报告。

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恒生指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的投资指数时,经变更业绩比较基准涉及基金合同内容的,则本基金管理人应当变更业绩比较基准并且基金管理人应当变更业绩比较基准并并基金合同,并报中国证监会备案且在指定媒体公告;若变更业绩比较基准并并基金合同未涉及基金合同内容,则变更业绩比较基准并并基金合同,并报中国证监会备案且在指定媒体公告。

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,具有与标的指数及标的指数所表现的股票市场相似的风险收益特征,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较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。

此外,从投资者具体持有的基金份额来看,在分级运作期内,由于基础份额(添富恒生)的风险特征,恒生A份额的投资者面临低风险、收益稳定的明显特征,其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额;和股收益类的恒生B份额则表现出高风险、高收益的显著特征,其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额。

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月19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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至6月30日止。

1.1 报告期末基金资产组合情况

投资组合报告

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,210,407,112.59	67.41
	其中:普通股	1,210,407,112.59	67.41
	优先股	–	0.00
	存托凭证	–	0.00
	房地产信托凭证	–	0.00
2	基金投资	–	0.00
3	固定收益投资	–	0.00
	其中:债券	–	0.00
	资产支持证券	–	0.00
4	金融衍生品投资	–	0.00
	其中:远期	–	0.00
	期货	–	0.00
	期权	–	0.00
	权证	–	0.00
5	买入返售金融资产	–	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	0.00
6	货币市场工具	–	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	527,764,881.19	29.39
8	其他资产	57,447,498.15	3.20
9	合计	1,795,619,492.63	100.00

注:本基金通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为668,696,960.80人民币,占期末净值比例37.33%。

1.2 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	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
香港	1,210,407,112.59	67.64
合计	1,210,407,112.59	67.64

1.2 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(%)
10 能源	89,587,398.27	5.01
11 原材料	70,819,518.88	3.96
25 非必需消费品	30,638,158.88	1.71
30 必需消费品	25,776,436.97	1.44
40 金融	680,840,865.94	38.05
45 信息科技	129,168,610.35	7.22
50 电信服务	107,174,182.15	5.99
55 公用事业	76,401,941.15	4.27
合计	1,210,407,112.59	67.64

1.4 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	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(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	700 HK	香港联合交易所	香港	817,700	123,069,890.35	6.88
2	HSBC HOLDINGS PLC	汇丰控股	5 HK	香港联合交易所	香港	2,767,600	112,000,965.17	6.26
3	AIA GROUP LTD	友邦保险	1299 HK	香港联合交易所	香港	2,549,400	100,991,815.60	5.64
4	CHINA MOBILE LTD	中国移动	941 HK	香港联合交易所	香港	1,300,000	98,496,444.15	5.50
5	CHINA CONSTRUCTION B	建设银行	939 HK	香港联合交易所	香港	17,805,000	77,913,084.67	4.35
6	IND & COMM BK OF CHI	工商银行	1398 HK	香港联合交易所	香港	15,611,000	57,238,266.96	3.20
7	BANK OF CHINA LTD-H	中国银行	3968 HK	香港联合交易所	香港	16,810,000	44,394,038.34	2.48
8	CHEUNG KONG HOLDINGS	长和	1 HK	香港联合交易所	香港	571,848	41,323,079.47	2.31
9	HONG KONG EXCHANGES	香港交易所	388 HK	香港联合交易所	香港	242,900	38,945,636.75	2.18
10	PING AN INSURANCE GR	中国平安	2318 HK	香港联合交易所	香港	1,103,000	32,193,239.49	1.80

1.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

1.6 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明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

1.7 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明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	期货品种_股指	HSI1607	465,472,084.74	26.01

1.9 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基金投资明细

注:本基金本报告期末未持有基金。

1.10 投资组合报告附注

1.10.1报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。

1.10.2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。

1.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	43,672,808.30
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	13,608,206.27
4	应收利息	56,740.63
5	应收申购款	109,742.95
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	
9	合计	57,447,498.15

1.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

1.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

九、基金的业绩

本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

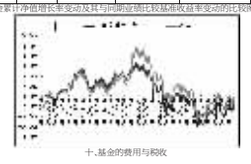
2016年第2号)

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。

1.基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:

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)
2014年3月6日(基金合同生效日)至2014年12月31日	6.20%	0.76%	3.79%	0.82%	2.41%	-0.06%
2015年1月1日至2015年12月31日	-7.15%	1.28%	-1.21%	1.30%	-5.94%	-0.02%
2016年1月1日至2016年6月30日	-1.68%	1.37%	-0.59%	1.31%	-1.09%	0.06%
2014年3月6日(基金合同生效日)至2016年6月30日	-3.04%	1.14%	-0.02%	1.15%	-3.02%	-0.01%

2.自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较图



十、基金的费用与税收

(一)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(含境外托管人收取的费用);

3.《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

4.(基金合同)生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

5.基金份额持有人大会费用;

6.基金合同生效以后的信息披露费用。

7.基金的银行汇划费用;

8.基金收益分配时发生的费用。

9.基金进行外汇兑换交易的相关费用。

10.与基金缴纳税收有关的手续费、汇款费等。

11.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。

12.基金依照有关法律法规应当缴纳的,购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税及预扣提税(以及与前述各项有关的任何利息及费用)(即称“税收”);

13.基金上市费用及年费;

14.标的指数的许可使用费;

15.按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.20%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书,于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

2.基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书,于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3.基金的指数使用费

本基金作为指数基金,需要根据与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法计提指数使用费。指数使用费日基金前次结算之日起累计,计算方法如下:

H=E×0.04%÷当年天数

H为每日应计提的指数使用费

E为前一日的基金资产净值

若一个会计年度累计计提指数使用费金额小于指数使用许可协议规定的费用下限,则基金于年末最后一日补提指数使用费至指数使用许可协议规定的费用下限。

如指数使用费日计提,按季支付,经基金管理人和基金托管人核对一致后,基金托管人于次季度首日起15日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,由基金管理人根据指数使用许可协议所规定的方式支付给标的指数许可方。

如指数使用费的计算方法和费率等发生调整,本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒体进行公告。

上述“一、基金费用的种类中第3-15项费用”,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1.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;

2.基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3.《基金合同》生效前的相关费用;

4.其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)基金管理人和基金托管人可以根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日按照《信息披露办法》的规定在指定媒体上刊登公告。

(五)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律,法规执行。

十一、基金管理人

一、基金管理人简况

名称:汇添富基金管理股份有限公司

住所:上海市浦东新区张杨路201号9层3室

办公地址:上海市富城路99号震旦国际大楼22楼

法定代表人:李文

成立时间:2006年2月3日

批准设立机关:中国证券监督管理委员会

批准设立文号:证监基字[2006]5号

注册资本:人民币117,762,297.7万元

联系人:李鹏

联系电话:021-28932888

股东名称及其出资比例:

股东名称	股权比例
东方证券投资有限公司	39.96%
上海上投资产管理有限公司	22.53%
东航金控有限责任公司	22.53%
上海普聚金投资管理合伙企业(有限合伙)	14.98%
合计	100%

二、主要人员情况

(一)董事会成员

李文生:董事长,国籍:中国,1967年出生,复旦大学法学博士,现任汇添富基金管理股份有限公司董事长。历任中国人民银行广州分行横枪处科长,中国人民银行杏林支行,国家外汇管理局海南支局副行长,副局长,中国人民银行厦门市中心支行副行长,厦门市人民政府外经贸委主任,厦门市人民政府外经贸局巡视组组长,厦门市人民政府台湾事务办公室主任,厦门市人民政府台湾事务办公室主任,厦门市人民政府外经贸局巡视组组长