恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书（更新）摘要

2017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联接基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2012年6月14日证监许可[2012]832号文核准募集。本基金基金合同于2012年8月21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。

本基金为恒生ETF的联接基金，基金净值会因为恒生ETF净值波动等因素产生波动，恒生ETF主要跟踪香港市场的恒生指数，其投资的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。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：香港市场波动、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；由于基金份额持有人选择大量赎回基金产生的流动性风险；本基金的特定风险等。本基金为恒生ETF的联接基金，主要通过投资恒生ETF变更跟踪标的指数的费用，与恒生ETF在投资方法、交易方式等方面存在着较系统区别。恒生ETF为股票型指数基金，风险本基金的风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

本基金的目标ETF主要投资于香港市场以港币计价的金融工具，本基金除投资目标ETF外，也可能投资于香港市场，港币相对于人民币的汇率变化可能会影响本基金的资产净值，从而对基金业绩产生影响。本基金同时以人民币和美元申购赎回份额，美元申购赎回份额为按照基金份额净值换算以中国人民银行最新公布的人民币对美元汇率中间价计算的美元折算净值，由于存在汇率波动，可能导致以美元计量的收益率和以人民币计量的收益率有所差异。

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，并在分析和判断的基础上做出投资决定。基金的过往业绩并不预示未来表现。

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。基金投资者自依照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说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2017年8月21日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2017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联接基金。

二、基金的类型

本基金类型:契约型开放式。

三、基金的投资目标

本基金主要通过对恒生ETF基金份额的投资，追求跟踪标的指数表现最相似的回报。

四、基金的投资方向

本基金主要投资于目标ETF基金份额及跟踪标的指数的股票组合。基金在境内可投资于在中国市场工具类法律法规或中国证监会允许基金投资的金融工具，此外，基金还可投资于港外证券市场的股票、债券、基金、金融衍生工具（包括但不限于远期合约、互换、期货、期权、权证等）以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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

本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标ETF。根据投资者申购、赎回的现金流情况，本基金将综合性主要ETF的流动性、折溢价率、标的指数成分股流动性等因素分析，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数，基金还将适度参与恒生ETF基金份额交易和申购、赎回的组合管理，以增强基金收益。基金也可以通过交入股生指期货或价股索取股标的指数。为了更好地实现投资目标，基金还将投资于港外证券市场的股票、债券、期货等一种或多种金融工具等产品，并在法规允许的条件下参与证券借贷，以增加收益。

在目标ETF持有申购赎回之前，本基金可通过特殊申购的方式用基金资产换购目标ETF份额，以进行基金建仓。

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ODII基金进行外汇互换、互换价格需遵循公允、合理的原则以及监管机构的相关规定。

本基金为恒生ETF的跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。

基金管理人可根据市场情况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

本基金的业绩比较基准为：经人民币汇率调整的标的指数收益率×95%＋人民币活期存款税后利率×5%。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，人民币活期存款利率是指中国人民银行公布的金融机构人民币活期存款基准利率。

本基金标的指数变更的，业绩比较基准将随之变更。基金管理人可根据投资情况和市场情况调整基金业绩比较基准的组成和权重，不需另行召开持有人大会。

七、风险收益特征

本基金为恒生ETF的联接基金，恒生ETF为股票型指数基金，因此本基金的风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

八、基金投资组合报告

以下内容摘自本基金2017年第2季度报告：

5.1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	1,249,183,891.58	93.96
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	76,505,774.08	5.75
8	其他各项资产	3,846,859.63	0.29
9	合计	1,329,536,525.29	100.00

5.2报告期末在各个国家（地区）证券市场的投资及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。
5.3报告期末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。
5.4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
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。
5.5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。
5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。
5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。
5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	股指期货	HANG SENG IDX FUT Jul17	–	–
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,其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
HIN7	HANG SENG IDX FUT Jul17	20	22379670.40	5207.52
公允价值变动总额合计				5207.52
股指期货投资本期收益				545608.93
股指期货投资本期公允价值变动				249793.67

5.9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

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	华夏恒生ETF	股票型	交易型开放式	华夏基金管理有限公司	1,249,183,891.58	94.49
2	–	–	–	–	–	–
3	–	–	–	–	–	–
4	–	–	–	–	–	–
5	–	–	–	–	–	–
6	–	–	–	–	–	–
7	–	–	–	–	–	–
8	–	–	–	–	–	–
9	–	–	–	–	–	–
10	–	–	–	–	–	–

5.10投资组合报告附注
5.10.1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、处罚的情况。
5.10.2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。
5.10.3其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	1,549,104.62
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	4,458.01
5	应收申购款	2,293,297.00
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	3,846,859.63

5.10.4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。
5.10.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有股票。
5.10.6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。投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

下表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21日至2012年12月31日	3.00%	0.17%	11.07%	0.86%	–8.07%	–0.69%
2013年1月1日至2013年12月31日	–0.10%	0.91%	–0.17%	0.95%	0.07%	–0.04%
2014年1月1日至2014年12月31日	3.89%	0.85%	1.60%	0.85%	2.29%	0.00%
2015年1月1日至2015年12月31日	1.03%	1.31%	–1.21%	1.32%	2.24%	–0.01%
2016年1月1日至2016年12月31日	10.54%	1.08%	6.92%	1.12%	3.62%	–0.04%
2017年1月1日至2017年6月30日	14.37%	0.66%	12.93%	0.65%	1.44%	0.01%

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8层
设立日期:1998年4月9日
法定代表人:杨明辉
联系人:李彬
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、党委书记,中信证券股份有限公司执行董事、总经理,硕士,高级经济师。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、证通股份有限公司董事等。
杨一天先生:董事,硕士。现任衡尔太平有限公司总裁,负责总部加拿大衡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（世界银行集团成员）驻印尼的首席代表等。
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经济学家,法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。
孙国茂先生:董事,硕士,高级经济师。现任中信证券股份有限公司经纪业务发展与管理委员会主任。曾任中信证券股份有限公司证券管理总部总经理,金通证券股份有限公司总经理,中信证券（浙江）有限责任公司总经理,党委书记、执行董事,中信证券股份有限公司经纪业务发展与管理委员会副主任等。
路小淑先生:董事,硕士。中信证券党委委员、董事总经理。葛先生于2007年荣获全国金融五一劳动奖章。
梁晓东先生:董事,总经理,硕士。曾任新于摩根大通、荷兰银行、苏格兰皇家银行、中国证监会等。
朱家祥先生:独立董事,博士,教授。现任诺亚大学经济管理学院金融系教授,博士生导师,兼任北京建设（香港上市）、华夏幸福基金、中海油海洋工程、东兴证券、中兴通讯等上市公司独立董事。
曾建平先生:独立董事,大学本科,高级经济师。现已退休,兼任东海银行独立董事,曾任银行北京工艺品进出口公司,美国纽约中银集团产权公司（外派工作）,曾担任中国银行信托咨询公司副处长、处长,中国银行香港分行副总经理,中国银行信托投资公司副总经理,中国银行证券有限责任公司董事长、总经理,中国银行投资管理公司副董事长、总经理,中国银行国际上市办公室、董事会秘书办公室、上市办公室总经理,中国基金管理有限公司董事长。
蒋锡仁先生: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,兼任中华联合人寿保险股份有限公司、博成科技股份有限公司（上市公司）、朗新科技股份有限公司独立董事,中国会计学会第八届理事会理事,中国会计学会财务成本分会第八届理事会副会长。
张晋教授先生:副总经理,博士。民营化上海医药金融学院常席教授,诺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,美国纽约证券交易所（华盛顿总部）经济学家,摩根士丹利（纽约总部）信用分析主管及易赖恒风险主管,中国银监会银行监管三届副主任等。
刘义先生:副总经理,硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员,曾任中国人民银行总行计划资金司副主任科员、主任科员,中国农业发展银行总行信息电脑部信息综合处副处长（主持工作）,华夏基金管理有限公司监事、党办主任、养老金业务总监,华夏资金管理有限公司执行董事、总经理等。
郑福先生:副总经理,投资总监,硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员。曾任中国对外经济贸易信托投资有限公司财务部部门经理,宝盈基金管理有限公司基金经理助理,益民基金管理有限公司投资部部门经理,华夏基金管理有限公司股票投资部副总经理等。
李一梅女士:副总经理,硕士。兼任证券投资有限公司董事。曾任基金管理部总经理,管销总监,市场总监,上海华夏财富投资管理有限公司执行董事、总经理等。
周蒙女士:董事长,硕士。现任华夏基金管理有限公司纪委书记。曾任华夏基金管理有限公司总经理助理;曾任职于中国证监会,北京金融街建设开发公司。
李红辉先生:董事长,硕士。现任国开证券股份有限公司总经理。曾任国家开发银行总行计划资金司副主任科员、主任科员,国家开发银行信息科技部副总经理,国开证券股份有限公司筹备组副组长、董事、总经理、党委书记等职。
王一飞先生:董事,硕士。现任中国证券业协会秘书长。曾任证券业协会秘书处秘书、证监会证券机构监管部、证券期货市场监管部、证券期货市场监管一部、证券期货市场监管二部、证券期货市场监管三部、证券期货市场监管部、证券期货监管部、证券期货监管一部、证券期货监管二部、证券期货监管三