# 大成恒生指数证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要

基金管理人：大成基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
二〇一九年十二月

## 重要提示

大成恒生指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）经中国证监会2015年11月25日证监许可【2015】2748号文予以注册，并于2017年4月13日获得中国证监会证券基金机构监管部《关于对大成恒生指数证券投资基金（LOF）延期募集备案的回函》（机构部函【2017】072号）。基金合同于2017年5月10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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明中国证监会对本基金的价值和取益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能投其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型，投资者投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资者承担的风险也越大。

大成恒生指数证券投资基金（LOF）是股票指数型基金，风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金。本基金投资于香港证券市场，基金净值除了会因香港证券市场波动等因素产生波动之外，还需面临汇率风险等投资海外市场的特殊风险。投资者在投资本基金前，应仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并根据自身财投资目的、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，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对申购基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立、谨慎决策，获得基金投资收益，亦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、个别证券持有的非系统性风险、由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的操作或技术风险、本基金的特有风险等，巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个交易日基金的净赎回申请超过基金总份额的日分之十时，投资者将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金管理人承诺依照恪尽职守，诚实信用，谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，投资人认购（或申购）基金时，请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负担。

本基金按照份额初始面值1.00元发售，在市场波动等因素的影响下，基金份额净值可能低于份额初始面值，投资者存在遭受损失的风险。

投资者应当通过本基金管理人或代销机构购买本基金，基金代销机构名单详见本基金《大成恒生指数证券投资基金（LOF）招募说明书》或《大成恒生指数证券投资基金（LOF）基金份额发售公告》。

本更新的招募说明书所载内容截止日为2019年8月10日（其中入员变动信息以公告日为准），有关财务数据和基金净值表现截止日为2019年6月30日，所列财务数据未经审计。

## 一、风险提示

本基金为投资于香港市场的股票型指数基金，其主要面临以下三类风险：一是境外投资的特殊风险，包括海外市场风险、汇率风险、政府管制风险、法律风险、政治风险以及税务风险；二是本金特有风险，包括指数授权风险、金融模型风险、跟踪误差风险、衍生品投资风险、证券借贷和证回购/逆回购风险、港股通特定业务风险、单一投资者集中度较高的风险；三是开放式基金投资的一般风险，包括上市公司经营风险、流动性风险、信用风险、利率风险、大额交易风险、会计核算风险、交易结算风险、操作或技术风险以及不可抗力风险。

（一）境外投资的特殊风险

1. 海外市场风险

海外市场风险是指由于基金投资于海外证券市场，因商会受到不同国家或地区（对本基金而言，主要指香港）特有的政治因素、法律制度、经济周期等基本因素的影响，导致基金绩效面临较大的波动性和存在潜在损失的风险。例如香港证券交易市场对每日证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，使得证券的每日涨跌幅有存在较大交证的可能性，另外，香港的会计准则和信息披露制度与中国相比会有较大差异，可能导致基金管理人对公司盈利能力和投资价值判断产生偏差，从而也会给投资带来潜在的风险。

2. 汇率风险

本基金以人民币募集和计价，经过换汇后投资于香港市场以港元计价的金融工具。港币相对于人民币的汇率变化将会影响本基金以人民币计价的基金资产价值，从而导致基金资产价值潜在风险。

3. 政府管制风险

政府管制风险是指国家政府机关通过制定相关法律法规或采用行政干预手段对社会经济行为实施直接控制而使基金资产有遭受损失的风险。在境外证券投资过程中，基金所投资的国家/地区（对本基金而言，主要是香港）可能会不时采取某些管制措施，如资产冻结、对公司盈利、资产、资产收入及征收高额税收等，造成相应的财产受损、交易延误等相关风险，从而对基金收益以及基金资产带来不利影响。

4. 法律风险

由于香港的法律法规与中国大陆不同的原因，可能导致本基金在投资运作、交易结算以及资金汇出入等方面受到限制，从而使得基金资产面临损失的可能性。

5. 政治风险

香港因政治局势变化（如罢工、暴动、战争等）或法令的变动，可能导致市场的较大波动，从而给本基金的投资收益造成直接或间接的影响。

6. 税务风险

由于香港在税务方面的法律法规存在一定差异，可能会要求基金就股息、利息、资本利得等收益向当地税务机构缴纳税金，该行为会使基金收益受到一定影响。此外，香港的税收规定可能发生变化，或者实施具有追溯力的修订，从而导致基金向香港缴纳在基金前售、估值或者出售投资当日并未预计的额外税项。

（二）本基金特有风险

1. 指数授权风险

本基金管理人依据指数授权许可协议依法取得在中国境内发行大成恒生指数证券投资基金（LOF）的权利。

恒生指数由恒生指数有限公司根据恒生供讯服务有限公司的授权发布及编制，恒生指数的商标及名称由恒生供讯服务有限公司全权拥有，恒生指数有限公司及恒生供讯服务有限公司在恒生指数证券投资基金使用及参考该指数，但是，恒生指数有限公司及恒生供讯服务有限公司并不就此该指数的适用性或适合性；或(ii)任何人士因使用该指数或其中任何成份或其所包涵的数据而产生的结果，而向本基金的任何经纪或本基金分额持有人或任何其它人士作出保证或声明或担保，也不会就该指数提供或提示任何保证、声明或担保，恒生指数有限公司可随时更改或修改计算及编制该指数及其任何有关的公式、成份股份及系数的过程及基准，而无需作出通知。在适用法律允许的范围内，恒生指数有限公司或恒生供讯服务有限公司不会就(i)该指数或其中任何成份或其所包涵的数据的适用性或适合性；或(ii)任何人士因使用该指数或其中任何成份或其所包涵的数据而产生的结果，而向本基金的任何经纪或本基金分额持有人或任何其它人士作出保证或声明或担保，也不会就该指数提供或提示任何保证、声明或担保。恒生指数有限公司可随时更改或修改计算及编制该指数及其任何有关的公式、成份股份及系数的过程及基准，而无需作出通知。在适用法律允许的范围内，恒生指数有限公司或恒生供讯服务有限公司不会就(i)大成基金或本基金使用及/或参考该指数；或(ii)恒生指数有限公司在计算该指数时的任何失准、遗漏、失误或错误；或(iii)与计算该指数有关并由任何其它人士提供的资料的任何失准、遗漏、失误、错误或不完整；或(iv)任何经纪、本基金分额持有人或任何其它交易本基金分额的人士，因上述原因而直接或间接蒙受的任何经济或其它损失承担任何责任或债务。任何经纪、本基金分额持有人或任何其它交易本基金分额的人士不得因本基金、以任何形式向恒生指数有限公司及/或恒生供讯服务有限公司进行索偿、法律行动或法律诉讼。任何经纪、持有人或任何其它人士，须在完全了解此免责声明，并且不能依赖恒生指数有限公司及恒生供讯服务有限公司的情况下交易本基金。为避免产生疑问，本免责声明不构成任何经纪、持有人或任何其它人士与恒生指数有限公司及/或恒生供讯服务有限公司之间任何合约或合约关系，也不应视作因此而构成这种关系。任何投资者从购买购买本基金权益，该投资者将被视为已承认、理解并接受此免责声明并受其约束，以及承认、理解并接受本基金所使用之该指数数值为恒生指数有限公司的情计算的结果。

十四、基金的险收益特征

本基金属于股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金基金资产将投资于香港市场，除了需要承担与海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。

十五、基金报告的组合报告

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定，于2019年8月22日复核了本基金投资组合报告中的财务指标、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。

本投资组合报告所载数据截至2019年6月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

（一）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 | 15,684,435.15 | 89.28 |
| | 其中：普通股 | 15,684,435.15 | 89.28 |
| | 优先股 | – | – |
| | 存托凭证 | – | – |
| | 房地产信托凭证 | – | – |
| 2 | 基金投资 | – | – |
| 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 | – | – |
| | 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 | 1,295,861.99 | 7.38 |
| 8 | 其他资产 | 587,557.30 | 3.34 |
| 9 | 合计 | 17,567,854.44 | 100.00 |

注：本基金通过深港通交易机制投资的港股公允价值为15,684,435.15元，占期末基金资产净值的比例为94.17%。

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(%) |
|---|---|---|
| 中国香港 | 15,684,435.15 | 94.17 |
| 合计 | 15,684,435.15 | 94.17 |

注：以股票的国家（地区）类别根据其所在证券交易所确定。

2.本基金本报告期未持有存托凭证。

（二）报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

（1）报告期末指数投资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(%) |
|---|---|---|
| 医疗保健 | 216,264.41 | 1.30 |
| 信息技术 | 165,002.22 | 0.99 |
| 消费者非必需品 | 636,539.57 | 3.82 |
| 消费者常用品 | 431,380.86 | 2.59 |
| 能源 | 919,367.85 | 5.52 |
| 金融 | 7,677,822.02 | 46.10 |
| 基础材料 | – | 0.00 |
| 公用事业 | 817,857.90 | 4.91 |
| 工业 | 788,017.02 | 4.73 |
| 房地产 | 1,640,101.88 | 9.85 |
| 电信服务 | 2,392,081.42 | 14.36 |
| 合计 | 15,684,435.15 | 94.17 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

无。

（四）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

（1）报告期末指数投资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 | AIA GROUP LTD | 友邦保险 | 1299 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 23,600 | 1,749,027.98 | 10.50 |
| 2 | TENCENT HOLDINGS LTD | 腾讯控股 | 700 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 5,100 | 1,581,857.39 | 9.50 |
| 3 | HSBC HOLDINGS PLC | 汇丰控股 | 5 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 27,200 | 1,550,453.53 | 9.31 |
| 4 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 建设银行 | 939 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 234,000 | 1,385,306.16 | 8.32 |
| 5 | PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 中国平安 | 2318 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 11,000 | 907,633.19 | 5.45 |
| 6 | BANK OF CHINA LTD-H | 中国银行 | 3988 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 267,000 | 775,068.43 | 4.65 |
| 7 | CHINA MOBILE LTD | 中国移动 | 941 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 11,500 | 719,759.80 | 4.32 |
| 8 | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 香港交易所 | 388 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 2,200 | 533,742.50 | 3.20 |
| 9 | CNOOC LTD | 中国海洋石油 | 883 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 34,000 | 399,576.76 | 2.40 |
| 10 | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 长和 | 1 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 5,500 | 372,536.01 | 2.24 |

（2）报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票及存托凭证投资明细

无。

（五）报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

（六）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

无。

（七）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

无。

（八）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

无。

（九）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

无。

（十）投资组合报告附注

（1）报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的，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未超出基金合同规定的备选股票库。

（3）其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（人民币元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 50,235.03 |
| 2 | 应收证券清算款 | 449,989.55 |
| 3 | 应收股利 | 85,123.13 |
| 4 | 应收利息 | 264.50 |
| 5 | 应收申购款 | 1,945.09 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 587,557.30 |

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

1. 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

2. 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

十六、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。

（2019）自基金合同生效日（2017年8月10日）至2019年6月30日以来完整会计年度的基金份额净值增长率以及与同期业绩比较基准收益率的比较：

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2017.8. 10-2017.12.31 | 4.80% | 0.62% | 7.41% | 0.78% | -2.61% | -0.16% |
| 2018.01.01-2018.12.31 | -9.73% | 1.18% | -12.88% | 1.22% | 3.15% | -0.04% |
| 2019.01.01-2019.06.30 | 10.36% | 0.96% | 9.93% | 0.93% | 0.43% | 0.03% |
| 2017.08.10-2019.06.30 | 4.40% | 1.04% | 2.86% | 1.06% | 1.54% | -0.02% |

（二）自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较：

大成恒生指数证券投资基金（LOF）累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2017年8月10日至2019年6月30日）



注：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

十七、基金分额的申购与赎回

（一）申购与赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可以根据情况变更或增减销售机构，并在管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构的销售网点申购或赎回基金份额。基金管理人可以根据情况变更或增加通过其他方式为理基金份额的申购与赎回。

投资人可以通过场外、场内两种方式申购赎回本基金份额。本基金场外申购和赎回场所为场外销售机构的销售网点，场内申购和赎回场所为深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位。

办理本基金份额场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。

（二）申购和赎回的开放日及时间

1.开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，本基金的开放日为港股通交易日，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间在招募说明书或相关公告中载明。

基金合同生效后，若出现新的证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

2.申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始日与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购或者赎回或者转换，投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的视为无效申请，但法律、法规、中国证监会规定的情形除外。

基金份额申购、赎回的价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

（三）申购与赎回的原则

1. “未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为准进行计算；

2. “金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3. 当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4. 基金份额持有人在场外赎回基金份额时，赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人申购的先后次序进行顺序赎回；

5. 投资人办理场外申购、赎回应使用基金账户，办理场内申购、赎回应使用深圳证券账户；

6. 投资人通过深圳证券交易所交易系统办理本基金的场内申购、赎回时，需遵守深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则，若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对申购、赎回业务等规则有新的规定，按新规定执行。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（四）申购与赎回的程序

1.申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

2.申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购申请成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在T+10日(包括该日)内支付赎回款项。如基金投资所涉及的主要市场休市时，本基金所投资市场的交易清算规则有变更或国家外汇管理相关规定有变更时，赎回款项支付的时间将相应调整，在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

3.申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人可在T+2日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确认按收到申请、申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资人的任何损失由投资人自行承担。

如基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%，或者基金管理人认为可能存在妨碍赎回50%集中度限制的情形时，基金管理人有权对该单一投资者的申请部或部分确认失败。由此，给投资者造成的损失，有投资人自行承担。

（五）申购与赎回的数额限制

1.单个基金账户单笔申购的最低金额为1元，投资者可多次申购，累计申购金额不设上限。

2.基金全不对投资者每个交易账户的最低基金份额余额进行限制，亦不对单个投资者累计持有的基金份额上限进行限制，但单一投资者持有基金份额的比例不得达到或者超过50%，或者以其他方式变相规避50%集中度限制。

3.基金管理人可在法律法规允许的前提下，根据基金运作的实际情况并在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，调整上述规定中申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

4.当投资申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限，拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。

（六）申购与赎回的费率

本基金目前开通前端收费模式，将来根据市场发展状况和法律法规、监管机构的规定，可能增加新的收费模式，也可能相应增加新的基金份额种类，并可能调计算新基金份额类别的基金份额净值、增加新的收费模式，应当按照法律法规、监管机构的规定，履行适当的程序，并及时公告。新的收费模式的具体业务规则，请见有关公告、通知。

1.申购和赎回费率

（1）日常申购费率

本基金的申购费率最高不超过5.0%。本次公告的本基金日常申购费率具体为：

| 场外日常申购费率 | 日常申购金额（M） | 日常申购费率 |
|---|---|---|
| | M（100万元 | 1.20% |
| | 100万≤M（200万元 | 0.80% |
| | 200万≤M（500万元 | 0.50% |
| | M≥500万元 | 1000元/笔 |
| 场内日常申购费率 | 深圳证券交易所会员单位应按照场外日常申购费率 | |
| | 设定投资者的场内日常申购费率 | |

（2）日常赎回费率

场外赎回费率见下表。

| 持有基金时间（T） | 赎回费率 |
|---|---|
| T<7日 | 1.50% |
| 7日≤T（1年 | 0.50% |
| 1年≤T（2年 | 0.25% |
| T≥2年 | 0% |
| 注：1年指365天 | |

本基金对持续持有基金份额少于7日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有基金份额长于7日（含7日）的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的25%归入基金财产。

场内赎回费率见下表：

| 持有基金时间（T） | 赎回费率 |
|---|---|
| T<7日 | 1.5% |
| T≥7日 | 0.5% |

本基金对持续持有基金份额少于7日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有基金份额长于7日（含7日）的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的25%归入基金财产。

3.基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（七）申购份额与赎回支付金额的计算方式

1.基金申购份额的计算

基金申购采用金额申购的方式，投资者在申购时支付申购费用，申购费率随申购金额的不同而有所不同。计算公式为：

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

净申购金额＝申购金额/（1＋申购费率）

申购费用＝申购金额－净申购金额

申购份额＝净申购金额/申购当日基金份额净值

例：某投资者申购本基金100,000元，申购费率为1.20%，假设申购当日基金份额净值为1.045元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额＝100,000/（1＋1.20%）＝98,814.23元

申购费用＝100,000－98,814.23＝1,185.77元

申购份额＝98,814.23/1.045＝94,559.07份

即：该投资者投资100,000元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为1.045元，则可得到94,559.07份基金份额。

2.基金赎回金额的计算

本基金采用“份额赎回”方式，赎回价格以T日的基金份额净值为基准进行计算，计算公式：

赎回总金额＝赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用＝赎回总金额×赎回费率

净赎回金额＝赎回总金额－赎回费用

例：某投资者赎回10万份基金份额，对应的赎回费率为0.5%，假设赎回当日基金份额净值是1.016元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额＝100,000×1.016＝101,600元

赎回费用＝101,600×0.5%＝508元

净赎回金额＝101,600－508＝101,092元

即投资者赎回本基金10万份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是1.016元，则其可得到的赎回金额为101,092元。

3.基金份额净值的计算

本基金份额净值的计算，保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内在指定媒介上公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

4.申购份额的计算及金额的处理方式

申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份，份额单位为份，份额的计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。场内申购涉及份额的计算结果按份额单位为份，保留到整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资人资金账户。

5.净赎回金额的处理方式

净赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用，赎回净金额计算结果保留到小数点后2位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

6.基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对基金投资者适当调低基金申购费率和赎回费率。

（八）基金的登记和转托管

1.基金份额的登记

（1）本基金的份额采用分系统登记的原则，场内申购或上市交易买入的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下；场外申购买入的基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下。

（2）登记在证券登记结算系统中的基金份额既可以在深圳证券交易所上市交易，也可以直接申请场内赎回。

（3）登记在注册登记系统中的基金份额可以申请场外赎回。

2.系统内转托管

（1）系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为。

（2）基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的销售机构（网点）时，销售机构（网点）之间不能通存通兑的，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

（3）登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理上市交易或场内赎回的会员单位（交易单元）时，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

3.跨系统转登记

（1）跨系统转登记是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

（2）本基金跨系统转登记业务按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。

基金份额持有人可办理已持有基金份额不可销售机构之间的转登记，基金销售机构可以按照规定的标准收取转登记费。

本基金的登记、系统内转托管和跨系统转登记应遵守深圳证券交易所、证券登记结算有限公司的相关规定。

（九）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1.因不可抗力导致基金无法正常运作。

2.香港市场临时停市、港股通临时停市或者证券交易服务公司暂停提供港股通服务。

3.本基金基金管理人QDII额度不足或港股通交易每日额度或总额度不足。

4.发生基金合同规定的暂停基金资产净价值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。

5.证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

6.基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

7.基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情况。

8.基金管理人接受某笔或某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时。

9.当前一估值日基金资产净值占基金资产净值比例大于100%，其中以投资组合证券市场价值计算的股票市场相似的风险收益特征，本基金基金资产将投资于香港市场，除了需要承担与海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。

十六、基金报告的组合报告

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定，于2019年8月22日复核了本基金投资组合报告中的财务指标、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。

本投资组合报告所载数据截至2019年6月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

（一）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 | 15,684,435.15 | 89.28 |
| | 其中：普通股 | 15,684,435.15 | 89.28 |
| | 优先股 | – | – |
| | 存托凭证 | – | – |
| | 房地产信托凭证 | – | – |
| 2 | 基金投资 | – | – |
| 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 | – | – |
| | 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 | 1,295,861.99 | 7.38 |
| 8 | 其他资产 | 587,557.30 | 3.34 |
| 9 | 合计 | 17,567,854.44 | 100.00 |

注：本基金通过深港通交易机制投资的港股公允价值为15,684,435.15元，占期末基金资产净值的比例为94.17%。

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(%) |
|---|---|---|
| 中国香港 | 15,684,435.15 | 94.17 |
| 合计 | 15,684,435.15 | 94.17 |

注：以股票的国家（地区）类别根据其所在证券交易所确定。

2.本基金本报告期未持有存托凭证。

（二）报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

（1）报告期末指数投资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(%) |
|---|---|---|
| 医疗保健 | 216,264.41 | 1.30 |
| 信息技术 | 165,002.22 | 0.99 |
| 消费者非必需品 | 636,539.57 | 3.82 |
| 消费者常用品 | 431,380.86 | 2.59 |
| 能源 | 919,367.85 | 5.52 |
| 金融 | 7,677,822.02 | 46.10 |
| 基础材料 | – | 0.00 |
| 公用事业 | 817,857.90 | 4.91 |
| 工业 | 788,017.02 | 4.73 |
| 房地产 | 1,640,101.88 | 9.85 |
| 电信服务 | 2,392,081.42 | 14.36 |
| 合计 | 15,684,435.15 | 94.17 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

无。

（四）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

（1）报告期末指数投资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 | AIA GROUP LTD | 友邦保险 | 1299 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 23,600 | 1,749,027.98 | 10.50 |
| 2 | TENCENT HOLDINGS LTD | 腾讯控股 | 700 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 5,100 | 1,581,857.39 | 9.50 |
| 3 | HSBC HOLDINGS PLC | 汇丰控股 | 5 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 27,200 | 1,550,453.53 | 9.31 |
| 4 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 建设银行 | 939 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 234,000 | 1,385,306.16 | 8.32 |
| 5 | PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 中国平安 | 2318 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 11,000 | 907,633.19 | 5.45 |
| 6 | BANK OF CHINA LTD-H | 中国银行 | 3988 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 267,000 | 775,068.43 | 4.65 |
| 7 | CHINA MOBILE LTD | 中国移动 | 941 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 11,500 | 719,759.80 | 4.32 |
| 8 | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 香港交易所 | 388 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 2,200 | 533,742.50 | 3.20 |
| 9 | CNOOC LTD | 中国海洋石油 | 883 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 34,000 | 399,576.76 | 2.40 |
| 10 | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 长和 | 1 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 5,500 | 372,536.01 | 2.24 |

（2）报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票及存托凭证投资明细

无。

（五）报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

（六）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

无。

（七）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

无。

（八）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

无。

（九）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

无。

（十）投资组合报告附注

（1）报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的，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