

华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要

2015 年第 2 号

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

重要提示

华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2014 年 12 月

3 日证监许可[2014]1303 号文注册募集。本基金基金合同于 2014 年 12 月 23 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。

本基金跟踪香港市场股票指数，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：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；由于基金份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

险等。本基金是股票基金，风险高于货币市场基金、债券基金和混合基金。

本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，基金优先通过港股通投资标的指数的成份股、备

选成份股，未来如果出现由于沪港通额度受限、业务规则发生重大变更等影响投资运作的情形时，为了

更好地保护投资人利益，实现投资目标，本基金将可以直接委托香港的经纪商投资标的指数的成份股、

备选成份股。

在目前的结算规则下，T 日申购的基金份额在 T+1 日可以卖出或赎回。投资者认购本基金时需具有

上海证券账户，上海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，但需

注意：使用基金账户只能参与本基金的现金认购和二级市场交易，如投资者需要参与基金的申购、赎回，

则应使用 A 股账户。

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，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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 2015 年 12 月 23 日，有关财务数据和净值表现数据截止日为 2015 年

9 月 30 日。（本招募说明书中的财务资料未经审计）

一、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 12 层

设立日期：1998 年 4 月 9 日

法定代表人：杨明辉

联系人：张静

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、党委委员，硕士，高级经济师。兼

任华夏资本管理有限公司董事长。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

等。

杨一夫先生：董事，硕士。现任鲍尔太平有限公司总裁，负责总部加拿大鲍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（世界银行组织成员）

驻中国的首席代表等。

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高级经济学家，达沃

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。

徐刚先生：董事，博士。 现任中信证券执行委员会委员、董事总经理、经纪业务发展与管理委员会主

任、战略规划部行政负责人，亦担任中信证券（山东）有限责任公司、中信期货有限公司、前海股权交易

中心（深圳）有限公司、青岛蓝海股权交易中心有限责任公司、厦门两岸股权交易中心有限公司、证通股

份有限公司等公司董事。

葛小波先生：董事，硕士。 现任中信证券执行委员会委员、董事总经理、全球首席财务官、财务负责

人，亦担任金石投资有限公司、中信证券投资有限公司等公司董事，中信证券上海自贸试验区分公司负

责人。 葛先生于 2007 年荣获全国金融五一劳动奖章。

汤晓东先生：董事、总经理，硕士。 兼任华夏资本管理有限公司董事、上海华夏财富投资管理有限公司

司董事长。 曾任职于摩根大通、荷兰银行、苏格兰皇家银行、中国证监会等。

朱武祥先生：独立董事，博士，教授。 现任清华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）、华夏幸福基业、中海油海洋工程、荣信股份、东兴证券等五家上市公司独立董事。

贾建平先生：独立董事，大学本科，高级经济师。 现已退休。 兼任东莞银行独立董事。 曾任职于北京

工艺品进出口公司、美国纽约中国物产有限公司（外派工作），曾担任中国银行信托咨询公司副处长、处

长，中国银行卢森堡公司副总经理，中国银行意大利代表处首席代表，中银集团投资管理公司副董事长、

总经理，中国银行重组上市办公室、董事会秘书办公室、上市办公室总经理，中银基金管理有限公司董事

长。

谢德仁先生：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，兼任同方

环境股份有限公司、博彦科技股份有限公司（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。

张霄岭先生：副总经理，博士。 现兼任上海高级金融学院客座教授、清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、美国联邦储备委员会（华盛顿总部）经济学家、摩根士丹利

（纽约总部）信用衍生品交易模型风险主管、中国银监会银行监管三部副主任等。

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、养老金业务总监等。

阳琨先生：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

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。 兼任上海华夏财富投资管理有限公司总经理。 曾任基金营销部总经

理、营销总监、市场总监等。

孙毅先生：副总经理，硕士。 现任华夏资本管理有限公司董事、总经理。 兼任上海华夏财富投资管理

有限公司董事。 曾任中国南方证券有限责任公司投资银行部项目经理，国信证券股份有限公司投资银行

部高级经理，中信证券股份有限公司投资银行部副总经理，中信证券（香港）有限公司企业融资业务董

事总经理，中信证券股份有限公司投资银行业务执行总经理、董事总经理（担任投行委运营部、资本市场

部、交通行业组行政负责人）等。

周璇女士：督察长，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。

李红源先生：监事长，硕士，研究员级高级工程师。 现任南方工业资产管理有限责任公司总经理。 曾

任中国北方光学电子总公司信息部职员，中国兵器工业总公司教育局职员、主任科员、规划处副处长、计

划处处长，中国兵器装备集团公司发展计划部副主任、经济运营部副主任、资本运营部巡视员兼副主任。

吕翔先生：监事，学士。现任中信证券股份有限公司投资管理部执行总经理。曾任国家劳动部综合计

划与工资司副主任科员，中信证券股份有限公司人力资源管理部执行总经理。

张伟先生：监事，硕士，高级工程师。 现任山东高速投资控股有限公司党委书记、副总经理，兼任山东

渤海轮渡股份有限公司董事。 曾任山东省济青公路工程建设指挥部办公室财务科职员，济青高速公路管

理局经营财务处副主任科员，山东基建股份有限公司计划财务部经理，山东高速股份有限公司董事、党

委委员、总会计师。

汪贵华女士：监事，博士。 现任华夏基金管理有限公司董事总经理。 曾任财政部科研所助理研究员、

中关村证券股份有限公司计划资金部总经理、华夏基金管理有限公司财务总监等。

李彬女士：监事，硕士。现任华夏基金管理有限公司法律监察部总监。曾任中信证券股份有限公司基

金管理部项目经理、中信基金管理有限责任公司监察稽核部高级副总裁、华夏基金管理有限

公司法律监
察部副总经理等。

宁晨新先生：监事，博士，高级编辑。 现任华夏基金管理有限公司办公室总监、董事会秘书（兼）。 曾

任中国证券报社记者、编辑、办公室主任、副总编辑，中国政法大学讲师。

2、本基金基金经理

王路先生，博士。 曾任美国纽约德意志资产管理公司基金经理及定量股票研究负责人、美国纽约法

兴银行组合经理、大成基金国际业务部副总监等。 2008 年 11 月加入华夏基金管理有限公司，曾任数量投

资部总经理等，现任数量投资部执行总经理、首席量化投资官，恒生交易型开放式指数证券投资基金基

金经理（2012 年 8 月 9 日起任职）、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2012 年 8 月

21 日起任职）、上证原材料交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013 年 3 月 28 日起任职）、

上证主要消费交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013 年 3 月 28 日起任职）、上证金融地

产交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013 年 3 月 28 日起任职）、华夏沪港通恒生交易型

开放式指数证券投资基金基金经理（2014 年 12 月 23 日起任职）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券

投资基金联接基金基金经理（2015 年 1 月 13 日起任职）、华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经

理（2015 年 2 月 10 日起）。

张弘弢先生，硕士。 2000 年 4 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部总经理、数量投资部副

总经理等，现任数量投资部执行总经理，华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经

理（2009 年 7 月 10 日起任职）、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2012 年 8 月 9 日起任职）、

恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2012 年 8 月 21 日起任职）、华夏沪深 300 交易

型开放式指数证券投资基金基金经理（2012 年 12 月 25 日起任职）、上证能源交易型开放式指数发起式证

券投资基金基金经理（2013 年 3 月 28 日起任职）、上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金

基金经理（2013 年 3 月 28 日起任职）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2014

年 12 月 23 日起任职）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015 年 1 月

13 日起任职）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2015 年 2 月 12 日起任职）、

MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015 年 2 月 12 日起任

职)。

徐猛先生，清华大学工学硕士。曾任财富证券助理研究员，原中关村证券研究员等。2006年2月加入

华夏基金管理有限公司，曾任数量投资部基金经理助理等，现任数量投资部高级副总裁，上证金融地产

交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013年4月8日起任职）、华夏沪港通恒生交易型开放

式指数证券投资基金基金经理（2015年3月12日起任职）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资

基金联接基金基金经理（2015年3月12日起任职）、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理

（2015年12月21日起任职）、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015年12月21

日起任职）、上证原材料交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2016年1月29日起任职）。

3、本公司量化投资决策委员会

主任：王路先生，华夏基金管理有限公司数量投资部执行总经理、首席量化投资官，基金经理。

成员：汤晓东先生，华夏基金管理有限公司董事、总经理。

张弘弢先生，华夏基金管理有限公司数量投资部执行总经理，基金经理。

方军先生，华夏基金管理有限公司数量投资部总监，基金经理。

杨志诚先生，华夏基金管理有限公司数量投资部总监。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称“中国农业银行”）

住所：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人：刘士余

成立日期：2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号

注册资本：32,479,411.7万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国

农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司

公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成

为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型

国有商业银行

之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业

之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中

心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力

打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为

广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年

被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审

计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的

风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，

在 2010 年首届“‘金牌理财’ TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获

《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004 年 9

月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、

证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管

业务系统。

（二）主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 140 余名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专

家 10 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验

和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

（三）基金托管业务经营情况

截止到 2015 年 12 月 31 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 321

只。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、申购赎回代理机构

（1）国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：万建华

电话：021-38676161

传真：021-38670161

联系人：芮敏祺

网址：www.gtja.com

客户服务电话：400-888-8666

（2）中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

客户服务电话：400-888-8108

传真：010-65182261

联系人：权唐

网址：www.csc.com.cn

（3）国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

联系人：周杨

网址：www.guosen.com.cn

客户服务电话：95536

（4）招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 40 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：黄健

网址：www.newone.com.cn

客户服务电话：400-888-8111、95565

（5）广发证券股份有限公司

住所：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

电话：020-87555888

传真：020-87555417

联系人：黄岚

网址：www.gf.com.cn

客户服务电话：95575 或致电各地营业网点

（6）中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

电话：010-60833722

传真：010-60833739

联系人：陈忠

网址：www.cs.ecitic.com

客户服务电话：95548

（7）中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：陈有安

电话：010-66568430

传真：010-66568990

联系人：田薇

网址：www.chinastock.com.cn

客户服务电话：400-888-8888

（8）海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号 10 楼

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-63410456

联系人：金芸、李笑鸣

网址：www.htsec.com

客户服务电话：95553、400-888-8001

（9）申万宏源证券有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：李梅

客户服务电话：400-800-0562

传真：010-88085599

联系人：钱达琛

网址：www.hysec.com

（10）长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

网址：www.95579.com

客户服务电话：95579、400-888-8999

（11）安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：牛冠兴

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

网址：www.essence.com.cn

客户服务电话：400-800-1001

（12）西南证券股份有限公司

住所：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：余维佳

电话：023-63786141

传真：023-63786212

联系人：张煜

网址：www.swsc.com.cn

客户服务电话：400-809-6096

（13）湘财证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：林俊波

电话：021-68634510-8620

传真：021-68865680

联系人：赵小明

网址：www.xcsc.com

客户服务电话：400-888-1551

（14）中信证券（山东）有限责任公司

住所：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：吴忠超

网址：www.citicssd.com

客户服务电话：95548

（15）信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

电话：010-63081000

传真：010-63080978

联系人：唐静

网址：www.cindasc.com

客户服务电话：95321

（16）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号
办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号
法定代表人：薛峰
电话：021-22169081
传真：021-22169134
联系人：刘晨

网址：www.ebscn.com
客户服务电话：95525、400-888-8788

（17）东北证券股份有限公司
住所：长春市自由大路 1138 号
办公地址：长春市自由大路 1138 号
法定代表人：李福春
电话：0431-85096517
传真：0431-85096795
联系人：安岩岩

网址：www.nesc.cn
客户服务电话：95360

（18）国联证券股份有限公司
住所：无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦
办公地址：无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦
法定代表人：姚志勇
电话：0510-82831662
传真：0510-82830162
联系人：徐欣

网址：www.glsc.com.cn
客户服务电话：95570

（19）国都证券股份有限公司
住所：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层、10 层
办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层、10 层
法定代表人：常喆
电话：010-84183389
传真：010-84183311-3389
联系人：黄静

网址：www.guodu.com
客户服务电话：400-818-8118

（20）中泰证券股份有限公司
住所：山东省济南市市中区经七路 86 号
办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号
法定代表人：李玮
电话：0531-68889155
传真：0531-68889185
联系人：吴阳

网址：www.zts.com.cn
客户服务电话：95538

(21) 华鑫证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号

法定代表人：俞洋

电话：021-54967203

传真：021-54967293

联系人：王逍

网址：www.cfsc.com.cn

客户服务电话：021-32109999、029-68918888、400-109-9918

(22) 中国中投证券有限责任公司

住所：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层 -21 层及第 04 层

01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：高涛

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

联系人：刘毅

网址：www.china-invs.cn

客户服务电话：400-600-8008、95532

2、二级市场交易代理券商

包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。

3、本基金管理人可以根据情况变化增加或者减少销售机构，并予以公告。销售机构可以根据情况变

化增加或者减少其销售城市、网点。

(二) 登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系人：陈文祥

电话：021-68419095

传真：021-68870311

(三) 律师事务所

名称：北京市天元律师事务所

住所：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 10 层

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 10 层

法定代表人：朱小辉

联系电话：010-57763888

传真：010-57763777

联系人：李晗

经办律师：吴冠雄、李晗

(四) 会计师事务所

本公司聘请的法定验资机构为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市延安东路 222 号 30 楼

办公地址：中国北京市东长安街 1 号东方广场东方经贸城德勤大楼 8 层

法定代表人：卢伯卿

联系电话：010-85207788

传真：010-85181218

联系人：吕静

四、基金的名称

本基金名称：华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金。

五、基金的类型

本基金类型：交易型开放式。

六、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最小化。

七、基金的投资方向

本基金主要投资于跟踪标的指数的成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标，基金

还可投资于全球市场的债券、基金、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 80%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入

投资范围。

八、基金的投资策略

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

本基金股指期货投资主要遵循有效管理投资策略，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过

对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，谨慎参与股指期货投

资。此外，基金还将适度投资于期权等其他衍生品。

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 2%。

本基金优先通过港股通投资标的指数的成份股、备选成份股，未来如果出现由于沪港通额度受限、

业务规则发生重大变更等影响投资运作的情形时，为了更好地保护投资人利益，实现投资目标，本基金

将可以直接委托香港的经纪商投资标的指数的成份股、备选成份股，不需召开持有人大会。未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可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。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为经估值汇率调整的标的指数收益率。

若基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更，基金管理人可依据维护基金份额持有人合

法权益的原则，根据投资情况和市场惯例调整基金业绩比较基准的组成和权重，无需召开基金份额持有

人大会，但基金管理人调整业绩比较基准应取得基金托管人同意后，报中国证监会备案，基金管理人应

在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒介上刊登公告。

十、基金的风险收益特征

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。 本基金主要投资于标

的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金主要投资于香港证券市场中具有良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。

十一、基金的投资组合报告

以下内容摘自本基金 2015 年第 3 季度报告：

“ 5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
----	----	----	---------------

1	权益投资	296,076,785.71	96.99
---	------	----------------	-------

其中：普通股	296,076,785.71	96.99
--------	----------------	-------

存托凭证	--
------	----

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	--
----	----

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 7,233,122.43 2.37

8 其他各项资产 1,953,383.87 0.64

9 合计 305,263,292.01 100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

5.2 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

金额单位：人民币元

国家（地区） 公允价值 占基金资产净值比例
（%）

中国香港 296,076,785.71 97.23

合计 296,076,785.71 97.23

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

金额单位：人民币元

行业类别 公允价值 占基金资产净值比例
（%）

金融 167,682,757.04 55.07

信息技术 33,438,316.41 10.98

能源 18,639,751.35 6.12

电信服务 26,836,924.92 8.81

公用事业 15,316,339.35 5.03

工业 18,616,081.82 6.11

非必需消费品 7,655,288.61 2.51

必需消费品 7,891,326.21 2.59

材料 --

保健 --

合计 296,076,785.71 97.23

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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

金额单位：人民币元

序号 公司名称

（英文） 公司名称（中文） 证代券码 所 券在 市证 场 所 家（属地 国
区）

数量

（股） 公允价值

占基金

资产净

值比例

（%）

1 HSBC HOLDINGS

PLC 汇丰控股有限公司 00005 香港 中港 国香 724,800 34,273,080.89 11.26

2 TENCENT

HOLDINGS LTD 腾讯控股有限公司 00700 香港 中港 国香 296,200 31,413,709.89 10.32

3 CHINA MOBILE

LTD 中国移动有限公司 00941 香港 中港 国香 323,500 24,358,616.38 8.00

4 AIA GROUP LTD 友邦保险控股有限

公司 01299 香港 中港 国香 631,600 20,748,193.58 6.81

5

CHINA

CONSTRUCTION

BANK

中国建设银行股份

有限公司 00939 香港 中港 国香 4,432,000 18,721,585.70 6.15

6 IND & COMM BK

OF CHINA

中国工商银行股份

有限公司 01398 香港 中港 国香 3,885,000 14,212,207.23 4.67

7 CK HUTCHISON

HOLDING LTD

长江和记实业有限

公司 00001 香港 中港 国香 141,764 11,651,164.39 3.83

8 BANK OF CHINA

LTD

中国银行股份有限

公司 03988 香港 中港 国香 4,156,000 11,351,556.68 3.73

9

PING AN

INSURANCE

GROUP CO

中国平安保险(集团)

股份有限公司 02318 香港 中港 国香 274,000 8,618,894.82 2.83

10

CHINA LIFE

INSURANCE

COMPANY LTD

中国人寿保险股份

有限公司 02628 香港 中港 国香 390,000 8,573,043.96 2.82

注：所用证券代码采用当地市场代码。

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序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。

5.8 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

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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

本基金本报告期末未持有基金。

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、处罚的情形。

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 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号 名称 金额

1 存出保证金 -

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 1,929,000.10

4 应收利息 1,383.77

5 应收申购款 -

6 其他应收款 -

7 待摊费用 23,000.00

8 其他 -

9 合计 1,953,383.87

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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。”

十二、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。

下述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

2014 年 12 月 23 日至

2014 年 12 月 31 日 0.07% 0.01% 0.63% 1.05% -0.56% -1.04%

2015 年 1 月 1 日至

2015 年 9 月 30 日 -10.74% 1.38% -9.52% 1.43% -1.22% -0.05%

十三、费用概览

（一）基金运作费用

1、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。

（3）标的指数许可使用费（包括为指数公司缴纳的相关税收以及与支付外币相关的汇兑损益、手续费、汇款费等）。

（4）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用。

（5）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费。

（6）基金份额持有人大会费用。

（7）基金的证券交易费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费、融资融券费、证券账户相关费用及其他类似性质的费用等）。

（8）基金的银行汇划费用。

（9）基金上市费及年费。

（10）基金收益分配中发生的费用。

（11）基金进行外汇兑换交易的相关费用。

（12）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。

在中国证监会允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，不需召开持有人大会，具

体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明。

2、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 0.50% 年费率计提。 管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管

费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 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、公休假等，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 0.10% 的年费率计提。 托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向

基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支

取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

（3）标的指数许可使用费

基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与指数许可方签署的标的指数使用许可协

议的约定从基金财产中支付。

标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.04% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.04\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的标的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值。

标的指数许可使用费每日计算，按季支付。本基金及其联接基金的标的指数许可使用费收取下限合

计为每季度人民币 2.5 万元。计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

如果标的指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基

金将采用调整后的方法或费率计算标的指数许可使用费。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告

中披露基金最新适用的方法。

（4）本条第（一）款第 1 项中第（4）至第（12）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。

3、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。

（二）基金销售费用

投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理机构可按照不超过 0.5% 的标准收取佣金，其中包含

证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

十四、对招募说明书更新部分的说明

华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）依据《基金法》、《运作办

法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他法律法规的要求，对本基金管理人于 2015 年 8 月 6

日刊登的本基金招募说明书（更新）进行了更新，主要更新内容如下：

（一）更新了“三、基金管理人”中相关内容。

（二）更新了“四、基金托管人”中相关内容。

（三）更新了“五、相关服务机构”中相关内容。

（四）更新了“八、基金份额的交易”中基金份额参考净值（IOPV）汇率公允价相关信息。

（五）更新了“九、基金份额的申购与赎回”中相关内容。

（六）更新了“十、基金的投资”中“基金投资组合报告”相关内容，该部分内容均按

有关规定编制。

（七）更新了“ 十一、基金的业绩” 的相关内容，该部分内容均按有关规定编制，并经托管人复核。

（八）更新了“ 十三、基金资产的估值” 中估值汇率相关信息。

（九）更新了“ 二十二、对基金份额持有人的服务” 中相关内容。

（十）增加了“ 二十三、其他应披露事项” ，披露了自上次招募说明书更新截止日以来涉及本基金的相关公告。

华夏基金管理有限公司

二〇一六年二月五日