汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金更新招募说明书摘要

（2013年第1号）

基金管理人：汇丰晋信基金管理有限公司
基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

【重要提示】

汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2011年11月17日证监许可[2011]1833号文核准募集。

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做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人承诺恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉地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预示其未来表现。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也要承担相应的投资风险。基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素变化对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，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，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，某一基金的特定风险等。本基金属于股票型指数基金，属证券投资基金中的高风险、高收益品种，其长期平均风险和收益预期高于混合型基金，债券型基金和货币市场基金。投资有风险，投资人认购（申购）本基金时应认真阅读本招募说明书及基金合同。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2013年2月1日，有关财务数据和净值表现截止日为2012年12月31日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：汇丰晋信基金管理有限公司
住所：上海市浦东新区富城路99 号震旦大厦35 楼
办公地址：上海市浦东新区富城路99 号震旦大厦35 楼
法定代表人：杨小勇
设立日期：2005 年11 月16 日
批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2005】172 号
组织形式：有限责任公司
注册资本：2亿元人民币
存续期间：持续经营
联系人：周慧
联系电话：021-38789898

股权结构：山西信托有限责任公司持有51%的股权，HSBC Global Asset Management（UK）Limited（汇丰环球投资管理（英国）有限公司）持有49%的股权。

（二）主要人员情况

1. 董事会成员

杨小勇先生，董事长，硕士学历。曾任山西省委组织部正处级干部、山西省信托投资公司副总经理、山西省国信投资（集团）公司副总经理，山西光信实业有限公司副董事长。现任山西省国信投资（集团）公司党委书记、山西信托有限责任公司副董事长。

刘叔肄先生，董事，硕士学历。曾任山西信托有限责任公司地市信托部经理、太原资产管理公司经理、汇丰晋信基金管理有限公司副督察长。现任山西信托有限责任公司总经理。

Mr. Sridhar Chandrasekharan，董事。曾任汇丰银行董事总经理、结构化信贷全球市场主管、汇丰环球投资管理全球销售主管。现任汇丰环球投资管理首席执行官。

Ms. JOANNA MUNRO，董事。曾任汇丰环球投资管理全球投资总监、多元基金经理行政总裁、环球投资产品部主管。现任汇丰环球投资管理亚太行政总裁。

常修泽先生，独立董事。曾任南开大学经济研究所教授、副所长、国家计委经济研究所常务副所长、教授和博士研究生导师。现任国家发改委经济研究所教授和博士研究生导师。

叶林先生，独立董事，博士学历。现任中国人民大学法学院法学教授和博士研究生导师。

Mr. Alan Howard SMITH，独立董事，本科学历。曾任怡富控股有限公司董事、董事总经理和董事长、瑞士信贷第一波士顿副董事长。现任金威啤酒集团有限公司独立非执行董事。

2. 监事会成员基本情况：

任宏伟先生，监事，硕士学历。曾任山西省信托投资公司计划财务部经理。现任山西省国信投资（集团）公司财务总监兼计划财务部经理。

黄碧娟女士，监事，本科学历。曾任汇丰集团银团贷款经理、资本市场部高级经理、大中华地区债务发行部主管、环球银行部香港区常务总监、汇丰银行（中国）有限公司副行政总裁。现任汇丰集团总经理、汇丰银行（中国）有限公司行长兼行政总裁，同时担任汇丰中国董事会执行董事。

曹菁女士，监事，硕士学历。曾任中宏保险有限公司招聘经理、永乐中国培训部经理、汇丰晋信基金管理有限公司人事经理，现任汇丰晋信基金管理有限公司人力资源总监。

3. 总经理及其他高级管理人员基本情况：

王栋先生，总经理，硕士学历。中国注册会计师（CPA）和特许金融分析师(CFA)。曾任汇丰环球投资管理（英国）有限公司产品开发培训生、汇丰环球投资管理（香港）有限公司亚太企业拓展经理，其后参与筹建汇丰晋信基金管理有限公司。公司成立至今历任财务总监、特别项目部总监、国际业务与战略伙伴部总监、总经理助理。

闫太平先生，副总经理，本科学历。曾任匈牙利金鸥国际贸易公司董事、山西信托投资有限责任公司副处长、国际金融部经理。

李毅先生，副总经理，硕士学历。曾任中国国际期货经纪有限公司客户经理、中国证券监督管理委员会副处长。

林彤彤先生，副总经理，硕士学历。曾任华安基金管理有限公司基金安信、基金安久、基金安顺、基金安瑞的基金经理，投资部总监助理兼基金安信基金经理。现任汇丰晋信基金管理有限公司首席投资官，并担任汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金基金经理。

王立荣，副总经理，硕士学历。曾任山西信托有限责任公司固定收益部副总经理、证券投资部副总经理、创新业务部总监；上海万方投资管理有限公司副总经理；汇丰晋信基金管理有限公司副督察长。

古韵女士，督察长，硕士学历。曾任国泰君安证券股份有限公司法律事务总部副经理，国联安基金管理有限公司监察稽核部副总监、监察稽核部总监、董事会秘书和总经理助理。

4. 本基金基金经理

方磊女士，方磊女士，华东师范大学数理统计系学士，新加坡南洋理工大学数学系硕士。方磊女士曾任职于新加坡辉立证券公司任金融工程师，在三年任职期间，其运用金融量化模型，为公司自营业务建立了多种投资套利模型以及各类标的指数的优化复制模型，包括股指期货与指数现货间、各类金融期货间（包括股票期货等）的套利模型，同时运用量化分析为公司做市商业务建立了程序化自动做市交易模型，其在海外证券市场上的金融交易模型研究以及量化投资有丰富的实战经验。回国后，其分别任职于易评咨询有限公司顾问统计，以及德隆友联战略投资管理有限公司数据分析师等。参与易评咨询有限公司的中国基金评估业务体系筹建，依靠扎实的量化分析基础，负责公司对中国市场的基金绩效评估工作，并运用基金风险调整后收益、业绩持续性以及择时能力等量化指标在中国基金指数建立方面进行了大量的研究和量化分析工作；参与德隆友联战略投资管理有限公司对集团下属分支机构的风险管理，运用数学模型理论，建立包括信用风险评估、流动性风险管理、资产负债结构管理以及利率风险管理等量化风险管理。

方磊女士于2006年加入汇丰晋信基金管理有限公司，曾任公司风险管理部副总监，协助管理层运用量化分析理论对各类投资组合进行业绩和风险绩效评估，并使用流动性风险、跟踪误差和投资组合周转率等辅助风险控制指标对基金投资风险定期进行动态风险管理。方磊女士不仅在风险量化分析和研究方面有扎实的理论功底，而且在运用量化分析工具进行证券投资的长期实践中，也积累了丰富的实战经验。

5. 投资委员会成员的姓名和职务

王栋，总经理；林彤彤，副总经理兼首席投资官、汇丰晋信龙腾股票型证券投资基金基金经理；曹庆，研究总监兼汇丰晋信科技先锋股票型证券投资基金基金经理；王品，股票投资部总监兼汇丰晋信大盘股票型证券投资基金基金经理和汇丰晋信消费股票型证券投资基金基金经理；郑宇尘，固定收益部总监兼汇丰晋信平稳增利债券型投资基金基金经理。基金管理人也可以根据需要增加或更换相关人员。

6. 上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司(简称：中国邮政储蓄银行)
住所：北京市西城区金融大街3号
办公地址：北京市西城区金融大街3号A座
法定代表人：李国华
成立时间：2007年3月6日
组织形式：股份有限公司
注册资本：450亿元人民币
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：证监许可【2009】673号
联系人：王瑛
联系电话：010－68858126

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

（1）直销机构

汇丰晋信基金管理有限公司投资理财中心
地址：上海市浦东新区富城路99 号震旦大厦35 楼
电话：021-68596998
传真：021-68881922
联系人：薛蓓
客户服务中心电话：021-38789998
公司网址：www.hsbcjt.cn
汇丰晋信基金电子交易平台
网址：https://etrading.hsbcjt.cn/
联系人：薛蓓
电话：021-38789898*6659

（2）代销机构

中国邮政储蓄银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街3号
办公地址：北京市西城区金融大街3号A座
法定代表人：李国华
客户服务电话：95580
联系人：陈春林
传真：（010）68858117
公司网址：www.psbc.com
交通银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路188号
办公地址：上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人：胡怀邦
电话：（021）58781234
传真：（021）58408842
联系人：曹榕
客服电话：95559
网址：www.bankcomm.com
中国建设银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：王洪章
客户服务电话：95533
网址：www.ccb.com
中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
电话：010-66106912
传真：021-66107914
联系人：田耕
客户服务电话：95588
网址：www.icbc.com.cn
中国农业银行股份有限公司
住所：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人：项俊波
客户服务电话：95599
网址：www.abchina.com
招商银行股份有限公司
住所：深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人：傅育宁
电话：（0755）83195834，82090060
传真：（0755）83195049，82090817
联系人：刘薇
客户服务热线：95555
网址：www.cmbchina.com
上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址：上海市中山东一路12号
法定代表人：吉晓辉
电话：（021）61618888
传真：（021）63604199
联系人：汤嘉惠、虞谷云
客户服务热线：95528
公司网站：www.spdb.com.cn
宁波银行股份有限公司
注册地址：浙江省宁波市中山东路294号
法定代表人：陆华裕
客户服务电话：96528（上海地区962528）
网址：www.nbcb.com.cn
温州银行股份有限公司
住所、办公地址：温州市车站大道196号
法定代表人：邢增福
联系人：林波
电话：（0577）88990082
传真：（0577）88995217
客服电话：（0577）96699
网址：www.wzbank.cn
中国民生银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：董文标
电话：010-58351666
传真：010-83914283
联系人：董云巍
客户服务热线：95568
公司网站：www.cmbc.com.cn
渤海银行股份有限公司
注册地址：天津市河西区马场道201-205号
办公地址：天津市河西区马场道201-205号
法定代表人：刘宝凤
联络人：王宏
电话：022-58316666
传真：022-58316569
客服电话：400-888-8811
公司网址：www.cbhb.com.cn
上海农村商业银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区浦东大道981号
办公地址：上海市银城中路8号中融碧玉蓝天大厦15层
法定代表人：胡平西
联系人：吴海平
电话：021-38576666
传真：021-50105124
客服电话：021-962999
公司网址：http://www.srcb.com
洛阳银行股份有限公司
注册地址：洛阳市洛南新区开元大道256号洛阳银行大厦
法定代表人：王建甫
客服电话：96699
网址：http://www.bankofluoyang.com.cn
深圳发展银行股份有限公司
注册地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
办公地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人：法兰克纽曼（Frank N. Newman）
联系人：张青
联系电话：0755-82088888
客户服务电话：95501
网址：www.sdb.com.cn
平安银行股份有限公司
注册地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦
法定代表人：孙建一
客户服务电话：95511-3
网址：http://bank.pingan.com/
山西证券股份有限公司
注册地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
办公地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
法定代表人：侯巍
联系人：张冶国
联系电话：0351-8686703
传真：0351-8686619
客服电话：400-666-1618
网址：www.i618.com.cn
国泰君安证券股份有限公司
注册地址：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东路168号上海银行大厦29楼
法定代表人：万建华
联系人：芮敏祺
联系电话：021-38676161
传真：021-38670161
客服电话：400-8888-666
网址：www.gtja.com
申银万国证券股份有限公司
注册地址：上海市常熟路171号
法定代表人：丁国荣
联系人：李清怡
电话：021-54033888
传真：021-54030294
客户服务电话：021-962505
网址：www.sw2000.com.cn
中国银河证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人：顾伟国
联系人：李洋
电话：(010)66568047
传真：(010)66568116
客服电话：400-8888-888@ 网址：www.chinastock.com.cn
海通证券股份有限公司
注册地址：上海市淮海中路98号
办公地址：上海市广东路689号
法定代表人：王开国
联系人：金芸、李笑鸣
电话：021-23219000
传真：021-23219100
客服电话：95553或拨打各城市营业网点电话
网址：www.htsec.com
华泰证券有限责任公司
注册地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
联系人：樊昊
电话：025-84457777
传真：025-84579763
客户服务电话：95597
网址：www.htsc.com.cn
兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路268号
办公地址：上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层
法定代表人：兰荣
联系人：谢高得
电话：021－38565785
传真：021-38565955
客户服务电话：400-8888-123
网址：www.xyzq.com.cn
国信证券股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
法定代表人：何如
联系人：齐晓燕
电话：0755-82133066
传真：0755-82133302
客户服务电话：95536
网址：www.guosen.com.cn
中信证券股份有限公司
注册地址：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：北京市朝阳区新源南路6号京城大厦3层
法定代表人：王东明
联系人：陈忠
电话：010-84683893
传真：010-84865560
客服电话：010-84588888
网址：www.cs.ecitic.com
光大证券股份有限公司
注册地址：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：徐浩明
联系人：刘晨、李芳芳
电话：021-22169999
传真：021-22169134
客户服务电话：95525、10108998
网址：www.ebscn.com
中国国际金融有限公司
注册地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人：李剑阁
联系人：罗春蓉
客服电话：010-65051166
公司网址：www.cicc.com.cn
天相投资顾问有限公司
注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层
法定代表人：林义相
联系人：林爽
电话：010-66045529
传真：010-66045500
客服电话：010-66045678
公司网址：www.txsec.com、www.txjijin.com
东方证券股份有限公司
注册地址：上海市中山北路318号2号楼21-29楼
办公地址：上海市中山北路318号2号楼21-29楼
法定代表人：潘鑫军
联络人：吴宇、沈燕
电话：021-63325888
传真：021-63326173
客服电话：95503
公司网址：www.dfzq.com.cn
国金证券股份有限公司
注册地址：成都市东城根上街95号
办公地址：成都市东城根上街95号6、16、17楼
法定代表人：雷波
联系人：金喆
客户服务电话：400-660-0109
网址：www.gjzq.com.cn
国元证券股份有限公司
注册地址：合肥市寿春路179 号
法定代表人：凤良志
联系人：李蔡
电话：0551-2207938
传真：0551-2207965
客服电话：4008-888-777、95578
公司网址：www.gyzq.com.cn
中信证券（浙江）有限责任公司
注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法定代表人：沈强
联系人：丁思聪
客户服务电话：96598
网址：http://bigsun.qianyan.biz
长江证券股份有限公司
注册地址：湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：胡运钊
客户服务电话：95579
网址：http://www.95579.com
广发证券股份有限公司
注册地址：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：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人：孙树明
联系人：黄岚
统一客户服务热线：95575或致电各地营业网点
公司网站：www.gf.com.cn
中信建投证券股份有限公司
注册地址：朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市东城区朝内大街188号
法定代表人：张佑君
联系人：权唐
电话：010-85130577
传真：010-65182261
客户服务电话：400-8888-108(免长途费)
网址：www.csc108.com
安信证券股份有限公司
注册地址：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
联系人：陈剑虹
电话：0755-82558305
传真：0755-82558355
客服电话：4008001001
公司网址：www.essences.com.cn
中信万通证券有限责任公司
法定代表人：张智河
注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室）
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
基金业务联系人：吴忠超
电话：0532-85022326
传真：0532-85022605
客户服务电话：0532-96577
公司网址：www.zxwt.com.cn
招商证券股份有限公司
注册地址：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38-45层
法定代表人：宫少林
联系人：林生迎
电话：0755-82943666
传真：0755-82943636 客服电话：400-8888-111、95565
网址：www.newone.com.cn
深圳众禄基金销售有限公司
注册地点：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人：薛峰
客户服务电话：4006-788-887
联系人：张玉静
网址：www.zlfund.cn及www.jjmmw.com
上海天天基金销售有限公司
注册地点：上海浦东新区峨山路613号6幢551室
法定代表人：其实
联系人：朱钰
客户服务电话：400-1818-188
网址：www.1234567.com.cn
杭州数米基金销售有限公司
注册地点：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人：陈柏青
联系人：周嫦旻
客户服务电话：4000766123
网址：www.fund123.cn
浙江同花顺基金销售有限公司
注册地点：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903
法定代表人：李晓涛
联系人：杨翼
公司网站：www.10jqka.com.cn
客服电话：95105-885 0571-56768888
上海好买基金销售有限公司
注册地点：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
法定代表人：杨文斌
联系人：薛年
客户服务电话：400-700-9665
网址：ww.ehowbuy.com
诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司
注册地点：上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室
法定代表人：汪静波
联系人：姚思轶
公司网站：www.noah-fund.com
客服电话：400-821-5399
东海证券有限责任公司
注册地点：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
法定代表人：朱科敏
联系人：汪汇
公司网站：www.longone.com.cn
客服电话：400-8888-588
齐鲁证券有限责任公司
注册地点：山东省济南市经七路86号
法定代表人：李玮
公司网站：www.qlzq.com.cn
客服电话：95538

（二）注册登记机构

名称：汇丰晋信基金管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区富城路99 号震旦大厦35 楼
法定代表人：杨小勇
联系人：赵琳
联系电话：021-38789992

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：通力律师事务所
注册地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人：韩炯
电话：021-31358666
传真：021-31358600
联系人：黎明
经办律师：吕红 黎明

（五）审计基金财产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所
住所：北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层
法定代表人：萧伟强
联系电话：021-22122888
传真电话：021-62881889
经办注册会计师：戴丽、王国蓓
联系人：戴丽

四、基金的名称

汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金

五、基金的类型

股票型证券投资基金

六、基金的投资目标

本基金主要采取完全复制方法进行指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内，以实现对标的指数的有效跟踪。

七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股与备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券以及法律法规或中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他金融产品出现后，本基金在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于标的指数的成份股与备选成份股的组合比例不低于基金资产净值的90%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略

本基金为被动式指数基金，采用完全复制指数的投资策略，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%的投资目标。

当成份股发生分红、配股、增发等公司事件时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。

本基金建仓时间为3个月，3个月之后本基金投资组合比例达到《基金合同》的相关规定。

1、股票投资策略

本基金主要采取完全复制法来跟踪恒生A股行业龙头指数，即按照恒生A股行业龙头指数成份股组成及权重构建股票指数化投资组合。为求基金实际投资组合尽量贴近标的指数的表现，减小跟踪误差，基金管理人将根据实际情况对基金投资组合进行适当调整：

（1）指数成份股定期或临时调整。基金管理人将预测指数成份股调整方案，并判断指数成份股调整对投资组合的影响，在此基础上确定组合调整策略。

（2）基金发生申购赎回、参与新股申购等影响跟踪效果的情形。基金管理人将分析这些情形对跟踪效果的影响，据此对投资组合进行相应调整。

（3）指数成份股出现股本变化、增发、配股、派发现金股息等公司事件时，基金管理人将密切关注这些情形对指数的影响，并据此确定相应的投资组合调整策略。

（4）当标的指数成份股因停牌、流动性不足等因素导致基金无法按照指数权重进行配置，基金管理人将综合考虑跟踪误差和投资者利益，选择相关股票进行适当替代。本基金选择恒生A股行业龙头指数成份股或备选成份股构建替代成份股。

2、债券投资策略：

本基金可以投资于剩余期限在一年以内的政府债券和回购，其主要的作用为现金的替代资产，其投资的目的是在实现资产更高的流动性而非收益性。基金管理人将优先选择流动性较好的政府债券进行投资，并通过对基金现金需求的科学分析，合理分配基金资产在债券上的配置比例。

九、业绩比较基准

业绩比较基准 ＝恒生A股行业龙头指数 *95%+ 银行活期存款收益率(税后)*5%

十、风险收益特征

本基金属于股票型指数基金，属证券投资基金中的高风险、高收益品种，其长期平均风险和收益预期高于混合型基金，债券型基金和货币市场基金。

十一、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证基金投资组合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——中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年1月18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。

本基金投资组合报告的报告期为2012年10月1日起至12月31日止。本报告中的财务资料未经审计。

11.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	112,545,145.44	93.62
	其中：股票	112,545,145.44	93.62
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	6,651,416.87	5.53
6	其他各项资产	1,022,419.41	0.85
7	合计	120,218,981.72	100.00

11.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	16,377,186.40	13.82
C	制造业	39,364,514.79	33.22
C0	食品、饮料	10,177,068.24	8.59
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	1,176,766.86	0.99
C6	金属、非金属	6,662,454.04	5.62
C7	机械、设备、仪表	21,348,225.65	18.02
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	7,684,614.59	6.49
E	建筑业	6,052,488.02	5.11
F	交通运输、仓储业	5,516,649.98	4.66
G	信息技术业	6,288,907.95	5.31
H	批发和零售贸易	2,037,666.40	1.72
I	金融、保险业	18,228,064.19	15.38
J	房地产业	9,967,868.08	8.41
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	1,027,185.04	0.87
	合计	112,545,145.44	94.98

11.3 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投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000002	万 科A	693,389	7,370,725.07	6.22
2	600519	贵州茅台	31,299	6,542,116.98	5.52
3	601288	农业银行	1,991,888	5,577,286.40	4.71
4	601398	工商银行	1,185,745	4,920,841.75	4.15
5	601088	中国神华	186,525	4,728,408.75	3.99
6	601668	中国建筑	1,130,764	4,409,979.60	3.72
7	000651	格力电器	158,541	4,042,795.50	3.41
8	000527	美的电器	380,122	3,683,382.18	3.11
9	600104	上汽集团	207,432	3,659,100.48	3.09
10	000858	五 粮 液	128,762	3,634,951.26	3.07

11.4 报告期末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。

11.5 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。

11.6 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。

11.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

11.8 投资组合报告附注

11.8.1 报告期内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。

11.8.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

11.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	766,801.68
3	应收股利	-
4	应收利息	3,442.18
5	应收申购款	2,175.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,022,419.41

11.8.4 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。

11.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万 科A	7,370,725.07	6.22	重大事项
2	000527	美的电器	3,683,382.18	3.11	重大事项

11.8.6 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，投资组合报告中，市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

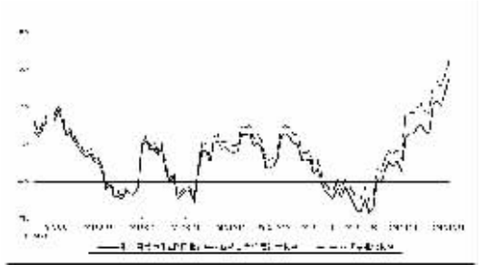
十二、基金的业绩

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。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。

（一）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
2012/8/1(基金合同生效日)-2012/12/31	4.28%	0.94%	5.62%	0.97%	-1.34%	-0.03%

（二）基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：

1.本基金的基金合同于2012年8月1日生效，截至2012年12月31日，基金合同生效未满1年。

2.按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：投资于标的指数的成份股与备选成份股的组合比例不低于基金资产净值的90%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。本基金自基金合同生效日起不超过三个月内完成建仓。截止2012年10月31日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

3.报告期内本基金的业绩比较基准 ＝恒生A股行业龙头指数 *95%+ 银行活期存款收益率(税后)*5%。

4.上述基金净值增长率的计算已包含本基金所投资股票在报告期产生的股票红利收益。同期业绩比较基准收益率的计算未包含恒生A股行业龙头指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

十三、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；
3.基金财产拨划支付的银行费用；
4.基金合同生效后的基金信息披露费用；
5.基金份额持有人大会费用；
6.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
7.基金的证券交易费用；
8.指数使用费；
9.证券账户开户费用、银行账户维护费用；
10.依法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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.75%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起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、休息日，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5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、休息日，支付日期顺延。

3、指数使用费

基金合同生效后，需根据指数使用许可协议的要求向标的指数的发布方恒生指数有限公司支付指数使用费。在通常情况下，指数使用费的计费时间从基金合同生效日开始计算，按前一日基金资产净值的0.02%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.02%÷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

指数使用费每日计提，按季支付，由基金管理人向基金托管人发送指数使用费划款指令，基金托管人复核后于次季前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，经由基金管理人向恒生指数有限公司支付上一季度的指数使用费。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

指数使用费的收取下限为每月人民币7,500元（若基金成立当月剩余时间不足一个月，且按当月实际剩余时间计算的指数使用费低于人民币7,500元，则按照人民币7,500元收取）。

如果指数使用费的费率或计算方法发生变动，本基金将采取调整后的费率和计算方法计算指数使用费。基金管理人必须按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒体及时公告。

3、除管理费、托管费和标的指数使用费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（三）不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（四）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的规定在指定媒体上刊登公告。

（五）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

（一）对“三、基金管理人”中的主要人员情况进行了更新，增加了董事会成员Mr. Sridhar Chandrasekharan的信息，删除了Mr.John Flint的信息；删除了总经理李选进的信息，增加了总经理王栋先生的信息；更新了投资委员会成员的信息。

（二）对“四、基金托管人”的基本情况、主要人员情况和基金托管业务经营情况进行了更新。

（三）更新了“五、相关服务机构”的有关信息。更新了中国工商银行股份有限公司的信息，增加了深圳发展银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、广发证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司、东海证券有限责任公司、齐鲁证券有限责任公司的信息。

（四）对“六、基金的募集”部分增加了募集相关情况。

（五）对“七、基金合同的生效”部分增加了基金合同生效相关信息。

（六）对“八、基金份额的申购与赎回”部分进行了更新。