华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
二〇一四年七月

重要提示

本基金于2014年4月2日经中国证券监督管理委员会《证监许可【2014】347号》文注册,进行募集。

本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。

本基金投资于德国证券市场,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、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。本基金是股票型基金,预期风险和预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金;本基金在股票型基金中属于指数型基金,主要采用完全复制法紧密跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征,本基金的业绩表现与标的指数的表现密切相关。本基金为境外证券投资的基金,主要投资德国证券市场上市的德国企业,需要承担汇率风险、境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

本基金为投资德国市场的ETF,基金份额的清算交收和境内普通ETF存在一定差异,通常情况下,投资人当日申购的基金份额,清算交收完成后方可卖出和赎回,即T日申购的基金份额在T+2日才可以卖出或赎回。当日买入的基金份额,同日可以赎回,但不得卖出。投资人认购本基金时需具有证券账户,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,如投资人需要参与基金的申购、赎回,则应使用A股账户。本基金以人民币募集和计价,经过换汇后主要投资于德国市场以欧元计价的金融工具,人民币对欧元的汇率的波动可能加大基金净值的波动,从而对基金业绩产生影响。

本基金初始募集净值1.00元。在市场波动因素影响下,本基金净值可能低于初始面值,本基金投资者有可能出现亏损。因折算、分红等行为导致基金份额净值变化,不会改变基金的风险收益特征,不会降低基金投资风险或提高基金投资收益。

投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。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。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在作出投资决策后,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。

一、绪言

《华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》(以下简称“本招募说明书”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)及其他有关规定以及《华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、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》、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。

二、释义

本招募说明书中除非文意另有所指,下列词语具有如下含义:

基金或本基金:	指华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金;
《基金合同》:	指《华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对《基金合同》的任何有效修订和补充;
《托管协议》:	指《华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充;
《招募说明书》或本《招募说明书》:	指《华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其定期更新;
《基金份额发售公告》:	指《华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》;
《上市交易公告书》	指《华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》
《业务规则》:	指上海证券交易所发布实施的《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则及上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司、华安基金管理有限公司发布的其他相关规则和规定;
中国:	指中华人民共和国(仅为《基金合同》目的,不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区);
中国证监会:	指中国证券监督管理委员会;
中国银监会:	指中国银行业监督管理委员会;
外管局:	指国家外汇管理局;
《基金法》:	指2003年10月28日第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订,自2013年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订;
《销售办法》:	指中国证监会2013年3月15日颁布,同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订;
《运作办法》:	指2004年6月29日由中国证监会公布并于2004年7月1日起施行的《证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订;
《信息披露办法》:	指中国证监会2004年6月8日公布、自同年7月1日起施行的《证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订;
《试行办法》:	指中国证监会于2007年6月18日公布、自同年7月5日起实施的《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及颁布机关对其不时做出的修订;
《通知》:	指中国证监会于2007年6月18日公布、自同年7月5日起实施的《关于实施<合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法>有关问题的通知》及颁布机关对其不时做出的修订;
交易型开放式指数证券投资基金:	指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”,简称“ETF”;
ETF联接基金:	指将绝大多数基金财产投资于本基金,与本基金的投资目标类似,采用开放式运作方式的基金,简称“联接基金”;
元:	指人民币元;
基金管理人:	指华安基金管理有限公司;
基金托管人:	指招商银行股份有限公司;
境外托管人:	指符合法律法规规定的条件,根据基金托管人与其签订的合同,为本基金提供境外资产托管服务的境外金融机构;
登记结算业务:	指《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》定义的基金份额的登记、存管和结算及相关业务;
登记结算机构:	指办理登记结算业务的机构。本基金的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司;
证券登记结算系统:	指中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记结算系统;
投资者:	指个人投资者、机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者;
个人投资者:	指符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然人;
机构投资者:	指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织;
基金份额持有人:	指依《招募说明书》和《基金合同》合法取得基金份额的投资者;
基金募集期:	指《基金合同》和《招募说明书》中载明,并经中国证监会核准的基金份额募集期限,自基金份额发售之日起最长不超过3个月;
《基金合同》生效日:	指募集结束,基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和《基金合同》规定的,基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后,中国证监会的书面确认之日;
存续期:	指《基金合同》生效至终止之间的不定期期限;
工作日:	指上海证券交易所的正常交易日;
巨额赎回:	指在单个开放日,基金净赎回申请(赎回申请总数扣除申购申请总数后的余额)超过上一日本基金总份额的10%时的情形;
投资指令:	指基金管理人在运用基金财产进行投资时,向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令;
认购:	指在基金募集期内,投资者按照《基金合同》和《招募说明书》的规定申请购买本基金基金份额的行为;
发售:	指在本基金募集期内,销售机构向投资者销售本基金基金份额的行为;
申购:	指在《基金合同》生效后的存续期间,投资者根据《基金合同》和《招募说明书》的规定申请购买本基金基金份额的行为;
赎回:	指在《基金合同》生效后的存续期间,基金份额持有人按《基金合同》和《招募说明书》规定的条件要求将本基金份额兑换为申购赎回清单所规定对价的行为;
申购赎回清单:	指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件;
申购对价:	指投资者申购基金份额时,按基金合同和招募说明书规定应交付的现金替代、现金差额及其他对价;
赎回对价:	指基金份额持有人赎回基金份额时,基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给该基金份额持有人的现金替代、现金差额及其他对价;
标的指数:	指本基金跟踪的基准指数,德国DAX指数及其未来可能发生的变更;
最小申购、赎回单位:	指本基金申购份额、赎回份额的最低数量,在申购赎回方式下,投资者申购、赎回的基金份额应为最小申购、赎回单位的整数倍;
组合证券:	指本基金标的指数所包含的全部或部分证券;
现金替代:	指申购、赎回过程中,投资者按基金合同和招募说明书的规定,用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金;
现金差额:	指申购、赎回过程中,最小申购、赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最小申购、赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差;投资者申购、赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购、赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算;
基金份额参考净值:	指中证指数有限公司在开市后根据当日的申购赎回清单和中国人民银行最新公布的汇率中间价,计算并通过上海证券交易所发布的基金份额参考净值,简称IOPV;
预估现金部分:	指申购、赎回过程中,为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理券商预先冻结申请申购、赎回的投资者的相应资金,由基金管理人计算并公布的现金数额;
代销机构:	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金销售业务资格,并与基金管理人签订基金销售与服务代理协议,代为办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的代理机构,包括发售代理机构和申购赎回代理券商;
发售代理机构:	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,由基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构;
发售协调人:	基金管理人指定的协调本基金发售等工作的代理机构;
申购赎回代理券商:	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,由基金管理人指定的办理本基金场内申购、赎回业务的证券公司,又称为代办证券公司;
销售机构:	指基金管理人及本基金代销机构;
基金销售网点:	指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点;
指定媒体:	指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊和基金管理人、基金托管人的互联网网站及其他媒体;
开放日:	指为投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日(即上海证券交易所和德国证券交易所的共同交易日);
T日:	指销售机构在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期;
T+n日:	指T日后(不包括T日)第n个工作日,n指自然数;
交易时间:	指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段;
基金利润:	指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额;
收益评价日:	指基金管理人计算本基金累计报酬率与业绩比较基准累计报酬率差额之基准日;
基金累计报酬率:	指收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去100%(期间如发生基金份额折算,则以基金份额折算日为初始日重新计算);
业绩比较基准同期累计报酬率:	指收益评价日业绩比较基准收盘值(经汇率调整)与基金上市前一日业绩比较基准收盘值(经汇率调整)之比减去100%(期间如发生基金份额折算,则以基金份额折算日为初始日重新计算);
基金资产总值:	指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收款项以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和;
基金资产净值:	指基金资产总值减去基金负债后的净资产值;
基金份额净值:	指以基金资产净值除以基金份额余额所得的单位基金份额的价值;
基金资产估值:	指计算、评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程;
公司行为信息:	指证券发行人所公告的会或将会影响到基金资产的价值及权益的任何未完成或已完成的行动,及其他与本基金持仓证券所投资的发行公司有关的重大信息,包括但不限于权益派发、配股、提前赎回等信息;
法律法规:	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、部门规章及规范性文件、地方性法规、地方政府规章及规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充;
不可抗力:	指任何不能预见、不能避免并且不能克服,且在《基金合同》由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的,使《基金合同》当事人无法全部或部分履行《基金合同》的事件和因素。

三、风险揭示

(一)本基金相关的风险

1、市场风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理等市场因素的影响而波动,导致指数波动,从而使基金收益水平发生变化,产生风险。

2、境外投资风险

(1)汇率风险

本基金以人民币募集和计价,经过换汇后主要投资于德国市场以欧元计价的金融工具。欧元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,从而导致基金资产面临潜在风险。人民币对欧元的汇率的波动也可能加大基金净值的波动,从而对基金业绩产生影响。

此外,由于基金运作中的汇率取自汇率发布机构,如果汇率发布机构出现汇率发布时间延迟或是汇率数据错误等情况,可能会对基金运作或者投资者的决策产生不利影响。

(2)法律和政治风险

由于德国市场适用不同法律法规的原因,可能导致本基金的某些投资行为受到限制或合同不能正常执行,从而使得基金资产面临损失的可能性。此外,德国市场可能会不时采取某些管制措施,如资本或外汇管制、没收资产以及征收高额税收等,从而对基金收益以及基金资产带来不利影响。

(3)会计制度风险

德国市场对上市公司日常经营活动的会计处理、财务报表披露等会计核算标准的规定可能与境内存在一定差异,可能导致基金经理对公司盈利能力、投资价值的判断产生偏差,从而给本基金投资带来潜在风险。

(4)税务风险

德国市场在税务方面的法律法规可能与境内存在一定差异,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,德国市场的税收规定可能发生变化,或者实施具有追溯力的修订,从而导致基金向该市场所在地缴纳在基金销售、估值或者出售投资当日并未预计的额外税项。

3、投资标的指数的特有风险

本基金所追踪的DAX指数(DAX Index)是全球最知名的欧洲旗舰指数之一,成份股包含了30家在德国法兰克福股票交易所主板市场上市的规模最大、交易最活跃的德国公司股票,指数市值覆盖度达到德国市场的70%,是全球公认的最能代表德国经济表现的蓝筹基准指数。指数在反映德国蓝筹股票市场平均收益的同时也承担相应的市场风险。

4、基金投资组合收益与标的指数收益偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与目标指数的收益率发生偏离:

(1)由于标的指数调整成份股或变更编制方法,使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差。

(2)由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化,使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

(3)成份股派发现金红利、新股市值配售收益将导致基金收益率超过标的指数收益率,产生正的跟踪偏离度。

(4)由于基金投资过程中的证券交易成本,以及基金管理费、托管费和标的指数使用许可费的存在,使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。

(5)在本基金指数化投资过程中,基金管理人的管理能力,例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等,都会对本基金的收益产生影响,从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。

(6)其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制,基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同;因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大;因基金申购与赎回带来的现金变动;因指数发布机构指数编制错误等,由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

5、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个德国股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个德国股票市场的平均回报率可能存在偏离。

6、标的指数变更的风险

根据基金合同规定,如出现德国DAX指数被停止编制及发布、或德国DAX指数由其他指数替代(单纯更名除外)、或由于指数编制方法等重大变更导致德国DAX指数不宜继续作为标的指数、或证券市场上出现其他更合适投资的指数作为本基金的标的指数等原因而变更标的指数的情形,本基金将变更标的指数。在前述情形下,基于原标的指数的投资政策将会改变,投资组合将随之调整,基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致,投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

7、流动性风险

(1)本基金最小申购、赎回单位较高,中小投资者只能在二级市场上按二级市场交易价格卖出基金份额。

(2)由于本基金为投资德国市场的ETF,基金份额的清算交收和境内普通ETF存在一定差异,目前T日申购的基金份额在T+2日才可以卖出或赎回,存在基金份额不能及时变现的风险。

(3)基金将在上海证券交易所上市交易,但不保证市场交易一定活跃;基金的交易可能因各种原因被暂停,当基金不再符合相关上市条件时,基金的上市也可能被终止;此外基金投资于德国市场,德国市场的突发性情况也可能会对本基金的交易产生影响。

8、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

尽管本基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内,但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响,存在不同于基金份额净值的情形,即存在价格折溢价的风险。

9、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险

基金管理人或其委托的其他机构在开市后根据申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据,计算并发布基金份额参考净值(IOPV),供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV与实时的基金份额净值可能存在差异,IOPV计算可能出现错误,投资者若参考IOPV进行投资决策可能导致损失,需投资者自行承担。

10、退市风险

因本基金不再符合上海证券交易所上市条件被终止上市,或被基金份额持有人大会决议提前终止上市,导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

11、投资者申购失败的风险

如果投资者申购时未能提供符合要求的申购对价,或者基金管理人根据基金合同的规定拒绝投资者的申购申请,则投资者的申购申请失败。此外,如果基金可用的外汇额度不足,申购赎回代理券商应付资金不足或出现违约,投资者的申购申请也可能失败。

12、投资者赎回失败的风险

如果投资者赎回时持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金,或者投资者在登记结算机构办理基金份额交收时持有的符合要求的基金份额不足,或者基金管理人根据基金合同的规定拒绝投资者的赎回申请,则投资者的赎回申请失败。另外,基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购赎回单位,由此可能导致投资者按原最小申购赎回单位申购并持有的基金份额无法按照新的最小申购赎回单位全部赎回,而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

13、基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险

本基金收益分配原则为使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不以弥补亏损为前提,收益分配后可能存在基金份额净值低于面值的风险。

14、股指期货投资风险

本基金可投资于股指期货,股指期货作为一种金融衍生品,具备一些特有的风险点。投资股指期货主要存在以下风险:

(1)市场风险:是指由于股指期货价格变动而给投资者带来的风险。

(2)流动性风险:是指由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险。

(3)基差风险:是指股指期货合约价格和指数价格之间的价格差的波动所造成的风险,以及不同股指期货合约价格之间价格差的波动所造成的期现价差风险。

(4)保证金风险:是指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持股指期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险。

(5)信用风险:是指期货经纪公司违约而产生损失的风险。

(6)操作风险:是指由于内部流程的不完善,业务人员出现差错或者疏漏,或者系统出现故障等原因造成损失的风险。

15、第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理,存在以下风险:

(1)申购赎回代理券商因多种原因,导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止,由此影响对投资者申购赎回服务的风险。

(2)登记结算机构可能调整结算制度,如对投资者基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化,制度调整可能给投资者带来理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

(3)证券交易所、登记结算机构及其他代理机构可能违约,导致基金或投资者利益受损的风险。

16、管理风险与操作风险

基金管理人等相关当事人的业务发展状况、人员配备、管理水平与内部控制等对基金收益水平存在影响。因业务扩张过快、行业内过度竞争、对主要业务人员过度依赖等可能会产生影响投资者利益的风险。

相关当事人在业务各环节操作过程中,可能因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致风险。例如,申购与赎回清单编制错误、越权违规交易、欺诈行为及交易错误等风险。

17、技术风险

在本基金的投资、交易、服务与后台运作等业务过程中,可能因为技术系统的故障或差错导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、证券交易所、登记结算机构及销售代理机构等。

(二)不可抗力

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产有遭受损失的风险。基金管理人、基金托管人、证券交易所、登记结算机构和销售代理机构等可能因不可抗力无法正常工作,从而影响基金的各项业务按正常时限完成。

(三)声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资者自愿投资于本基金,须自行承担投资风险。

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外,本基金还通过代销机构销售。但是,本基金并不是代销机构的存款或负债,也没有经代销机构担保或者背书,代销机构并不能保证其收益或本金安全。

四、基金的投资

(一)投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

(二)投资范围

本基金投资于标的指数成份股、备选成份股、境外交易的跟踪同一标的指数的公募基金、依法发行或上市的其他股票、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具、回购、证券借贷、跟踪同一标的指数的股指期货等金融衍生品和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金投资标的指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%。

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,可以相应将其纳入本基金的投资范围;如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的,基金管理人在履行适当程序后,可相应调整投资比例限制,不需经基金份额持有人大会审议。

(三)投资策略

本基金主要采用完全复制法,即完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。在一般情况下,本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票资产组合,但因特殊情况(如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等)导致无法获得足够数量的股票时,本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%。为有效控制指数的跟踪误差,本基金在注重风险管理的前提下,将适度运用股指期货。

为更好地实现本基金的投资目标,本基金还将在条件允许的情况下投资于股指期货等金融衍生品,以期降低跟踪误差水平。本基金投资于金融衍生品的目标是使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数,以便更好地实现基金的投资目标,不得应用于投机交易目的,或用作杠杆工具放大基金的投资。若基金拟投资于金融衍生品的,需将有关投资方案通知基金托管人。本基金投资于股指期货等相关金融衍生品必须经过投资决策委员会的批准。

正常情况下,本基金力求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.3%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则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。

未来,随着全球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。

(四)投资限制

1. 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,除中国证监会另有规定外,本基金禁止从事下列行为:

(1)承销证券;

(2)违反规定向他人贷款或提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)购买不动产;

(5)购买房地产抵押按揭;

(6)购买贵重金属或代表贵重金属的凭证;

(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)参与未持有基础资产的卖空交易;

(11)购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层;

(12)直接投资与实物商品相关的衍生品;

(13)向基金管理人、基金托管人出资;

(14)从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动;

(15)当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制,不需经基金份额持有人大会审议。

除非法律法规和监管部门禁止,本基金可以投资境外托管人发行的金融产品。

2. 投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制:

(1)基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的20%。本款所称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达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行,但在基金托管账户的存款可以不受上述限制。

(2)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以外的其他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%,其中持有任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%。

(3)基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的10%。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以及中国证监会认定的其他资产。

(4)基金持有境外基金的市值合计不得超过基金净值的10%。持有货币市场基金可以不受前述限制。

(5)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%。

(6)为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的10%,临时借入现金的期限以中国证监会规定的期限为准。

(7)法律法规及中国证监会规定的其他投资限制。

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。若基金超过上述(1)-(6)项投资比例限制,应当在超过比例后30个工作日内采用合理的商业措施进行调整以符合投资比例限制要求。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更,致使本款约定的投资组合限制被修改或取消的,基金管理人在履行适当程序后,本基金可相应调整投资限制规定,不需经基金份额持有人大会审议。

3. 金融衍生品投资

基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理,不得用于投机或放大交易,同时应当严格遵守下列规定:

(1)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)基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台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)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:

1)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。

2)交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值,并且基金可在任何时候以公允价值终止交易。

3)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)基金拟投资衍生品,基金管理人在产品募集申请中应当向中国证监会提交基金投资衍生品的风险管理流程、拟采用的组合避险、有效管理策略。

(5)基金管理人应当在基金会计年度结束后60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年度报告。

(6)基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品。

4. 关于投资境外基金的限制

(1)每只境外基金投资比例不超过本基金基金资产净值的20%。本基金投资境外伞型基金的,该伞型基金应当视为一只基金。

(2)本基金不得投资于以下基金:

1)其他基金中基金;

2)联接基金(A Feeder Fund);

3)投资于前述两项基金的伞型基金子基金。

5. 本基金可以参与证券借贷交易,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担保物市值不低于已借出证券市值的102%。

(3)借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约,本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

(4)除中国证监会另有规定外,担保物可以是以下金融工具或品种:

1)现金;

2)存款证明;

3)商业票据;

4)政府债券;

5)中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构(作为交易对手方或其关联方的除外)出具的不可撤销信用证。

(5)本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

(6)基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

6. 基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易,并且应当遵守下列规定:

(下转B14版)

华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告

重要提示

1、华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)的募集已获中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)正监许可【2014】347号文注册。中国证监会对本基金的注册并不代表中国证监会对本基金的风险和收益作出实质性判断、推荐或者保证。

2、本基金是交易型、开放式、股票型证券投资基金。

3、本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司(以下简称“本公司”),基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”),本基金的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司。

4、本基金的募集对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者,以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

5、本基金自2014年7月14日至2014年8月1日进行发售。投资者可选择网上现金认购、网下现金认购两种方式。其中,网下现金认购的日期为2014年7月14日至2014年8月1日,网上现金认购的日期为2014年7月30日至2014年8月1日。如上海证券交易所对网上现金认购时间作出调整,我司将作出相应调整并及时公告。

本公司可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间,并及时公告。

6、本基金的网上现金发售代理机构包括具有基金代销业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司办理。

7、本基金管理人可办理网下现金认购。

8、办理本基金的网下现金认购的发售代理机构详见以下“网下现金发售代理机构”部分,各代销机构的办理网点、办理日期、办理时间和办理程序等事项参照各销售机构的具体规定。

9、投资人认购本基金时需具有上海证券交易所A股账户或上海证券交易所证券投资基金账户。

10、本基金认购费用或认购佣金比率不超过认购份额的0.08%。

11、网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为1,000份或其整数倍,最高不得超过999,999,000份。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的,每笔认购份额须为1,000份或其整数倍;投资人通过基金管理人办理网下现金认购的,每笔认购份额须在10万份以上(含10万份)。投资人可以多次认购,累计认购不设上限。

12、网上现金认购申请提交后,不可撤单;网下现金认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。

13、销售网点(指基金管理人和/或代销机构的代销网点)对申请的受理并不表示对该申请的成功确认,而仅代表销售网点确实接受了认购申请,申请的成功确认应以登记结算机构的确认登记为准。投资者可以在《基金合同》生效后通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

14、本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,请详细阅读刊登在2014年7月11日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》上的《华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。本基金的招募说明书及本公告将同时发布在本公司网站(www.huaan.com.cn)及各地代销机构网站。投资者亦可通过本公司网站了解本公司的详细情况和本基金发售的相关事宜。

15、各发售代理机构办理认购业务的办理网点、办理日期和时间等事项参照各发售代理机构的具体规定。在发售期间,除本公告所列的发售代理机构外,如增加其他发售代理机构,或已有发售代理机构增加新的代销网点,将及时公告。

16、投资者如有任何问题,可拨打本公司客户服务电话(40088-50099)、基金托管人招商银行客服电话95555以及各销售代理机构客户服务电话。

17、本公司综合各种情况对发售安排做适当调整。

18、基金募集期结束后,基金管理人确定本基金的申购赎回代理机构名单,经有关部门认可后,由上海证券交易所公告。本基金上市后,指定交易未在申购赎回代理机构的投资者只能进行本基金的二级市场买卖,如投资者需进行本基金的申购赎回交易,须指定交易或转指定交易到申购赎回代理机构。

19、风险提示

本基金投资于海外证券市场,基金净值会因为海外证券市场波动及汇率波动等因素产生波动,投资者在基金前,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、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

本基金是股票型指数基金,风险高于货币市场基金、债券型基金及混合型基金,属于高风险、高收益的开放式基金品种。投资者应当认真阅读本基金《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件,了解本基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

本基金初始募集净值1.00元。在市场波动因素影响下,本基金净值可能低于初始面值,本基金投资者有可能出现亏损。因折算、分红等行为导致基金份额净值变化,不会改变基金的风险收益特征,不会降低基金投资风险或提高基金投资收益。

20、本公司拥有对本基金份额发售公告的最终解释权。

一、本次发售基本情况

1、基金名称

华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金

2、基金代码及基金简称

基金认购代码:513033

基金二级市场交易代码:513030

场内简称:德国30

3、基金类型

股票证券投资基金

4、运作方式

交易型,开放式

5、基金存续期限

不定期

6、基金份额发售面值

每份基金份额发售面值为1.00元人民币。

7、募集目标

在国家外汇管理局批准的外汇额度