MSCI中国A股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1次

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

本基金经中国证监会2014年8月19日证监许可[2014]870号文注册募集。本基金基金合同于2015年2月12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做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:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场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管理风险,本基金的特定风险等。本基金是股票基金,风险和收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股,在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

对于场内申购,投资者申购的基金份额当日可卖出,当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回;即在目前结算规则下,T日申购的基金份额当日可卖出,T日申购当日未卖出的基金份额,T+1日不得卖出和赎回,T+1日交收成功后T+2日可卖出和赎回。因此,为投资者办理申购业务的代理机构若发生交收违约,将导致投资者不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额,投资者的利益可能受到影响。

场外申购赎回业务的申购费率、赎回费率可能会根据市场交易佣金水平、印花税率等相关交易成本的变动而调整。投资者在办理场外申购、赎回业务之前请仔细阅读本基金的招募说明书及基金管理人的相关公告。

场内投资本基金时需具有上海证券账户,但需注意,使用上海证券交易所基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易,如投资者需要使用MSCI中国A股指数成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金的场内申购、赎回,则应开立上海证券交易所A股账户;如投资者需要使用MSCI中国A股指数成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购,则还应开立深圳证券交易所A股账户。

场外申购、赎回本基金时需具有华夏基金管理有限公司基金账户。

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8月12日,有关财务数据和净值表现数据截止日为2015年6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,现任鲲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,经济师。现任中信证券股份有限公司执行委员会委员、董事总经理、经纪业务发展与管理委员会主任委员、研究部行政负责人,兼任中信证券(山东)、中信期货、前海股权交易中心、青岛蓝海股权交易中心、厦门两岸股权交易中心等公司董事。曾任中国地质机械仪器工业总公司干部,曾任职于中信证券股份有限公司研究咨询部、资产管理部、金融产品开发小组、金融组、研究部、股票销售交易部,担任经理、高级经理、部门副总经理、部门总经理、部门行政负责人等职务。

葛小波先生:董事,硕士,现任中信证券股份有限公司执行委员会委员、董事总经理,计划财务部行政负责人,兼任华夏资本管理有限公司董事,曾任中信证券股份有限公司投资银行部高级经理、上市部副主任、风险控制部执行总经理、交易部(现交易与衍生产品业务部)行政负责人。

汤晓东先生:董事、总经理,硕士。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,中国银行产森堡公司副总经理,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。

郑瑞先生:副总经理、投资总监,硕士,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。曾任基金营销部总经理、营销总监、市场总监等。

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。现任北京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。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

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交易式证券投资基金基金经理(2013年3月26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)。

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。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基本情况

名称:中国银行股份有限公司(简称"中国银行")
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期:1983年10月31日
注册资本:人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾玖亿元整
法定代表人:田国立
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]24号
托管部门信息披露联系人:王永民
传真:010-66594942
中国银行客服电话:95566

(二)基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具有海外工作、学习或培训经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。

(三)证券投资基金托管情况

截至2015年6月30日,中国银行已托管382只证券投资基金,其中境内基金356只,QDII基金26只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

三、相关服务机构

(一)基金份额销售机构

1.直销机构

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
法定代表人:杨明辉
客户服务电话:400-818-6666
传真:010-63136700
联系人:李一梅
网址:www.ChinaAMC.com

2.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:权益
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6楼
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:400-888-81111,95565

(5)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

(6)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

(7)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:金蕾、李笑鸣
网址:www.htsec.com
客户服务电话:021-962503,400-888-8001或拨打各城市营业网点咨询电话

(8)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

(9)长江证券股份有限公司
住所:武汉市新华路特区特号长江证券大厦
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

(10)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

(11)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.citicsd.com
客户服务电话:95548

(12)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:甘露
网址:www.cindasc.com
客户服务电话:400-800-8899

(13)长城证券股份有限公司
住所:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
办公地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:黄耀华
电话:0755-83516089
传真:0755-83515567
联系人:李春芳
网址:www.cgws.com
客户服务电话:400-666-6888,0755-33680000

(14)光大证券股份有限公司
住所: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: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

(15)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:杨树财
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:400-600-0686

(16)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:400-888-5288

(17)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

(18)齐鲁证券有限公司
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.qlzq.com.cn
客户服务电话:95538

(19)中国国际金融股份有限公司
住所:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人:金立群
电话:010-65051166
传真:010-65058065
联系人:罗春蓉、武明明
网址:www.cicc.com.cn
客户服务电话:010-65051166

(20)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:龙增来
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

3、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。

4、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

1、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

2、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
法定代表人:杨明辉
客户服务电话:400-818-6666
传真:010-63136700
联系人:朱威

(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:杨科
经办律师:吴冠雄、杨科

(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:MSCI中国A股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,以期获得与标的指数收益相似的回报。

七、基金的投资方向

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标,基金还可投资于非成份股、债券(含中小企业私募债券)、股指期货、权证、货币市场工具、国债期货以及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)。

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。

基金投资于跟踪标的指数的投资组合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%。

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足够数量的股票时,基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。

3、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,以降低股票仓位调整的交易成本,提高投资效率,从而更好地跟踪标的指数,实现投资目标。

4、国债期货投资策略

本基金投资国债期货,将根据风险管理的原则,充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征,在风险可控的前提下,适度参与国债期货投资。

本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%,年跟踪误差不超过2%。

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标的指数。

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,但基金管理人应取得基金托管人同意后,报中国证监会备案。

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。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股,在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

十一、基金的投资组合报告

以下内容摘自本基金2015年第2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	1,101,462,406.72	95.84
	其中:股票	1,101,462,406.72	95.84
2	固定收益投资	184,543.70	0.02
	其中:债券	184,543.70	0.02
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	38,370,300.84	3.34
7	其他各项资产	9,237,083.18	0.80
8	合计	1,149,254,334.44	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 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	7,385,319.37	0.64
B	采矿业	41,874,387.84	3.66
C	制造业	453,761,462.82	39.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	40,019,570.74	3.49
E	建筑业	40,929,338.47	3.57
F	批发和零售业	35,256,162.38	3.08
G	交通运输、仓储和邮政业	46,229,366.95	4.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	58,885,589.27	5.14
J	金融业	280,230,729.19	24.47
K	房地产业	56,746,805.40	4.96
L	租赁和商务服务业	15,661,200.26	1.37
M	科学研究和技术服务业	1,928,041.34	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	6,117,762.50	0.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	8,859,715.78	0.77
S	综合	7,576,954.41	0.66
	合计	1,101,462,406.72	96.19

5.3 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	399,819	32,761,168.86	2.86
2	600036	招商银行	1,171,752	21,935,197.44	1.92
3	600016	民生银行	1,783,837	17,731,339.78	1.55
4	600030	中信证券	644,880	17,353,720.80	1.52
5	601166	兴业银行	998,916	17,231,301.00	1.50
6	600000	浦发银行	902,881	15,312,861.76	1.34
7	601766	中国中车	701,630	12,881,926.80	1.12
8	000651	格力电器	198,532	12,686,194.80	1.11
9	600837	海通证券	494,736	10,785,244.80	0.94
10	000002	万 科A	720,775	10,465,653.00	0.91

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	184,543.70	0.02
8	其他	-	-
9	合计	184,543.70	0.02

5.5 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110031	航信转债	1,270	184,543.70	0.02
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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	风险说明
IC1507	IC1507	10	16,687,200.00	-3,395,590.91	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效地流动性管理。
IF1507	IF1507	19	24,947,760.00	-1,136,064.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效地流动性管理。
公允价值变动总额合计					-4,531,654.91
股指期货投资本期收益					12,832,414.91
股指期货投资本期公允价值变动					-4,531,654.91

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金,主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定,投资于基础资产与标的指数相关性较高的股指期货组合,旨在配合基金日常投资管理需要,更有效地进行流动性管理,以更好地跟踪标的指数,实现投资目标。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内,本基金投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。

5.11.2 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。

5.11.3 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	7,637,147.87
2	应收证券清算款	1,591,792.10
3	应收股利	-
4	应收利息	8,143.21
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,237,083.18

5.11.4 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。

5.11.5 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。

5.11.6 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
2015年2月12日至2015年6月30日	28.88%	2.18%	34.90%	2.26%	-6.02%	-0.08%

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。
(4)基金上市费及年费。
(5)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用。
(6)《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费。
(7)基金份额持有人大会费用。
(8)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)。
(9)基金的银行汇划费用。
(10)基金收益分配中发生的费用。
(11)基金的登记结算费用。
(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%的年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.50%÷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理费划款指令,基金托管人复核后于次月前2-5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、公休日等,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×0.10%÷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2-5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指数使用许可协议的约定从基金财产中支付。

指数许可使用费按当日基金管理费的15%的年费率计提。计算方法如下:

H=F×15%
H为每日应计提的指数许可使用费
F为当日的基金管理费。

指数许可使用费的下限为前一日基金资产净值的0.03%/当年天数,上限为前一日基金资产净值的0.035%/当年天数。

标的指数许可使用费每日计算,按季支付。计费期间不足一季度的,根据实际天数按比例计算。

如果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(11)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

1、场内申购、赎回的费用

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。

2、场外现金申购、赎回的费用

投资者在申购或赎回基金份额时,基金管理人参考当时市场的交易佣金、印花税等相关交易成本水平,收取一定的申购费和/或赎回费并归入基金资产,确保覆盖场外现金申赎引起的证券交易费用。

当前的申购、赎回费率如下:

申购费率:0.05%
赎回费率:0.15%

本基金的申购费由申购人承担,赎回费由赎回人承担,申购费与赎回费均全部归入基金资产。

基金管理人可根据市场情况调整申购费率、赎回费率,并及时公告。

3、场外股票申购、赎回的费用

投资者办理场外股票申购、赎回暂不收取申购费与赎回费。

十四、对招募说明书更新部分的说明

MSCI中国A股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1月16日刊登的本基金招募说明书进行了更新,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"六、基金的募集"中相关内容。
(五)更新了"七、基金合同的生效"中相关内容。
(六)更新了"八、基金份额的交易"中相关内容。
(七)更新了"九、基金份额的申购与赎回"中相关内容。
(八)在"十、基金的投资"中增加了"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。
(九)增加了"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。
(十)更新了"十五、基金的费用与税收"中相关内容。
(十一)更新了"十七、基金的信息披露"中相关内容。
(十二)更新了"二十二、对基金份额持有人的服务"中相关内容。