易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

基金管理人：易方达基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

重要提示

[illegible]年[illegible]月[illegible]日中国证券监督管理委员会（以下简称“证监会”）以《关于核准易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》（证监许可[illegible]）和[illegible]年[illegible]月[illegible]日《关于易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集时间安排的确认函》（基金部函[illegible]）的核准，进行募集。

国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作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

猿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。

源本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的[illegible]%。本基金投资于证券期货市场，基金净值会因为证券期货市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，请认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，承担基金投资中可能出现的各类风险。投资本基金可能遇到的主要风险包括：（1）本基金特有的风险，主要包括标的指数的风险、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、基金管理人代理申赎投资者买券卖券的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、退市风险、申购失败的风险、赎回失败的风险、投资者参考[illegible]做出投资决策的风险和[illegible]计算错误的风险、第三方机构服务的风险、管理风险、创新风险等；（2）投资风险，主要包括市场风险等；（3）运作风险，主要包括操作风险等；（4）不可抗力风险；等等。本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金跟踪香港市场股票指数，基金净值会因香港证券市场波动等因素而产生波动，同时面临汇率风险等投资境外市场的特殊风险。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

缘本基金由易方达基金管理有限公司独立管理，未聘请境外投资顾问。

远基金的过往业绩并不预示其未来表现。

苑在目前结算规则下，投资者当日申购的基金份额，清算交收完成后方可卖出和赎回，即[illegible]日申购的基金份额，[illegible]日交收成功后[illegible]日可卖出和赎回。当日买入的基金份额，同日可以赎回，但不得卖出。由于登记结算机构对现金替代采取非净额结算交收模式，当投资者赎回申请被登记结算机构确认后，被赎回的基金份额即被记减，但此时投资者尚未收到赎回现金替代款。投资者投资本基金时需具有证券账户，证券账户是指上海证券交易所粤股账户或上海证券交易所证券投资基金账户。

愿投资者一旦认购、申购或赎回本基金，即表示对基金认购、申购和赎回所涉及的基金份额的证券变更登记方式以及申购赎回所涉及现金替代的交收方式已经认可。

第一节 绪 言

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》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第[illegible]号《招募说明书的内容与格式》》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》（以下简称“《试行办法》”）、《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》（以下简称“《通知》”）等有关法律法规以及《易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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。

第二节 释 义

本招募说明书中除非文意另有所指，下列词语有如下含义：

基金合同	《易方达恒生中国企业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的修订和补充
中国	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）
法律法规	中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件
《基金法》	《中华人民共和国证券投资基金法》
《销售办法》	《证券投资基金销售管理办法》
《运作办法》	《证券投资基金运作管理办法》
《信息披露办法》	《证券投资基金信息披露管理办法》
元	中国法定货币人民币元
基金或本基金	依据《基金合同》所募集的易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金
交易型开放式指数证券投资基金	在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”
招募说明书或本招募说明书	《易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
托管协议	基金管理人与基金托管人签订的《易方达恒生中国企业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
发售公告	《易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》
中国证监会	中国证券监督管理委员会
银行监管机构	中国银行业监督管理委员会或其他经国务院授权的机构
外汇局	国家外汇管理局
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
基金份额持有人	根据《基金合同》及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者
发售代理机构	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	基金管理人指定的、在基金合同生效后代理办理本基金申购、赎回业务的证券公司，又称为代办证券公司
基金代销机构	发售代理机构和申购赎回代理券商
销售机构	基金管理人及基金代销机构
基金销售网点	基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点
登记结算业务	《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、托管和结算业务
登记结算机构	中国证券登记结算有限责任公司
《基金合同》当事人	受《基金合同》约束、根据《基金合同》享受权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
个人投资者	符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人
机构投资者	符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立的并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织
合格境外机构投资者	符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定的可投资于中国境内合法募集的证券投资基金的中国境外的基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构
投资者	个人投资者、机构投资者、合格境外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的总称
基金合同生效日	基金募集达到法律规定及《基金合同》约定的条件，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续，获得中国证监会书面确认之日
募集期	自基金份额发售之日起不超过[illegible]个月的期限
基金存续期	《基金合同》生效后合法存续的不定期之期间
日[illegible]	公历日
月	公历月
工作日	上海证券交易所的正常交易日
开放日	销售机构办理本基金份额申购、赎回等业务的工作日
赎回	申购、赎回或办理其他基金业务的申请日
赎回日	自赎回起第[illegible]个工作日（不包含赎回日）
认购	在本基金募集期内投资者购买本基金基金份额的行为
发售	在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金份额的行为
申购	基金合同生效后，投资者按基金合同规定的条件，向基金管理人购买基金份额的行为
赎回	基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件，要求将所持基金份额兑换为申购赎回清单所规定对价的行为
本基金的联接基金	指易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金
申购赎回清单	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	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	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赎回人的现金替代、现金差额及其他对价
组合证券	本基金标的指数成份股中的全部或部分证券
标的指数	恒生指数公司编制并发布的恒生中国企业指数及其未来可能发生的变更
完全复制法	一种跟踪指数的方法，通过购买标的指数中的所有成份证券，并且按照每种成份证券在标的指数中的权重确定购买的比例以构建指数组合，达到复制指数的目的
现金替代	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全部或部分证券的一定数量的现金
现金差额	最小申购赎回单位的资产净值与按[illegible]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和申购或赎回的最小申购、赎回单位数量计算
最小申购、赎回单位	本基金申购份额、赎回份额的最低数量，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
基金份额参考净值	中证指数有限公司在开市后根据当日的申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据及汇率数据，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“[illegible]”
预估现金部分	指由基金管理人估计并在[illegible]日申购赎回清单中公布的当日现金差额的估计值，预估现金部分由申购赎回代理券商《代办证券公司》预先冻结
指定交易	在上海证券交易所全面指定交易制度试行办法》中定义的“全面指定交易”
基金份额折算	基金管理人根据基金运作的需要，在基金资产净值不变的前提下，按照一定比例调整基金份额总额及基金份额净值
基金利润	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	基金管理人计算本基金累计报酬率与标的指数累计报酬率差额之基准日
基金累计报酬率	收益评价日基金份额净值（如基金份额折算，则采用剔除折算因素的基金份额净值）与基金上市前一上海证券交易所和香港证券交易所共同交易日基金份额净值之比减去[illegible]
标的指数同期累计报酬率	收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一上海证券交易所和香港证券交易所共同交易日标的指数收盘值之比减去[illegible]（使用估值汇率折算）
基金资产总值	基金所拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和
基金资产净值	基金资产总值减去基金负债后的价值
基金份额净值	计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数的数值
基金资产估值	计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值的过程
货币市场工具	指银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等中国证监会、中国人民银行认可的具有良好流动性的金融工具
指定媒体	中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站
运营备忘录	指由基金管理人、基金托管人、境外托管人就委托财产托管服务内容及流程另行达成的书面约定
不可抗力	基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件，如地震、海啸、系统故障等事件
巨额赎回	若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数扣除申购申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的[illegible]%，即认为是发生了巨额赎回

第三节 风险揭示

本基金的投资运作中可能出现的风险包括本基金特有的风险、投资风险、运作风险及不可抗力风险四类，其中，本基金特有的风险包括标的指数的风险、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、基金管理人代理申赎投资者买券卖券的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、退市风险、申购失败的风险、赎回失败的风险、投资者参考[illegible]做出投资决策的风险和[illegible]计算错误的风险、第三方机构服务的风险、管理风险、创新风险等；投资风险主要包括市场风险、政府管制风险、监管风险、政治风险、流动性风险、汇率风险、利率风险、衍生品风险、金融模型风险、信用风险等；运作风险主要包括操作风险、会计核算风险、税务风险、交易结算风险、法律风险、证券借贷[illegible]回购[illegible]回购风险等。

一、本基金特有的风险

（一）标的指数的风险

根据基金合同规定，如果变更标的指数的情形发生，基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，履行适当程序后，变更本基金的标的指数，投资者须承担指数变更带来的风险。此外，如果恒生指数公司提供的指数数据出现差错，基金管理人依据该数据进行投资，可能会对基金的投资运作产生不利影响。以下为本基金标的指数[illegible]恒生中国企业指数的编制商发布的免责声明：

“恒生中国企业指数由恒生指数有限公司根据恒生资讯服务有限公司的授权发布及编制。恒生中国企业指数的商标及名称由恒生资讯服务有限公司全权拥有。恒生指数有限公司及恒生资讯服务有限公司已同意[illegible]被许可方）可就[illegible]产品名称）（“该产品”）使用及参考该指数。但是，恒生指数有限公司及恒生资讯服务有限公司并不就[illegible]该指数及其计算或任何与之有关的数据的准确性或完整性；或[illegible]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[illegible]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，而向该产品的任何经纪或该产品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默示任何保证、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，而无须作出通知。在适用法律允许的范围内，恒生指数有限公司或恒生资讯服务有限公司不会因[illegible]被许何人）就该产品使用及[illegible]参考该指数；或[illegible]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[illegible]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[illegible]任何经纪、该产品持有人或任何其它交易该产品的人士，因上述原因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、该产品持有人或任何其它交易该产品的人士不得因该产品，以任何形式向恒生指数有限公司及[illegible]恒生资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资讯服务有限公司的情况下交易该产品。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[illegible]恒生资讯服务有限公司之间的任何合约或准合约关系，也不应视作已构成这种关系。任何投资者如认购或购买该产品权益，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、理解并接受该产品所使用之该指数数值为恒生指数有限公司酌情计算的结果。

如果投资者认购或购买产品权益，该投资者将被视为已承认、理解并接受免责声明并受其约束；以及产品所使用之指数水平为恒生指数公司酌情计算的结果。”

对于恒生指数公司上述免责声明中提及的可能对基金、投资者及相关服务机构造成的损失，基金管理人亦不承担任何责任。

（二）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香港股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个香港股票市场的平均回报率可能存在偏离。

（三）标的指数波动的风险

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、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

（四）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

员由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使[illegible]基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差；

圆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[illegible]基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差；

猿由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使[illegible]基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差；

源成份股派发现金红利、送配等所获收益可能导致基金收益率偏离标的指数收益率，从而产生跟踪偏离度；

缘由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差；

远在[illegible]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[illegible]基金的收益产生影响，从而影响[illegible]基金对标的指数的跟踪程度；

苑如果指数编制机构发布的指数数据出现错误，基金投资组合的收益率与标的指数的收益率也可能发生偏离；

愿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；基金申购与赎回带来的现金变动等。

（五）基金管理人代理申赎投资者买券卖券的风险

因涉及境外市场股票的买卖，在投资者申购、赎回本基金时，本基金组合证券中全部或部分证券需以一定数量的现金进行现金替代，并由基金管理人按照招募说明书规定代理申赎投资者进行相关证券买卖，投资者需承受买入证券的结算成本和卖出证券的结算金额的不确定性（含汇率波动风险）。

（六）基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

尽管本基金的运作力求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。

（七）退市风险

因本基金不再符合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。

（八）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。

（九）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。

（十）投资者参考[illegible]做出投资决策的风险和[illegible]计算错误的风险

中证指数有限公司在开市后根据基金管理人提供的计算依据及计算方法，实时计算并通过上海证券交易所发布基金份额参考净值（[illegible]），供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。[illegible]与实时的基金份额净值可能存在差异，[illegible]计算可能出现错误，投资者若参考[illegible]进行投资决策可能导致损失。

（十一）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：

员受多种因素影响，申购赎回代理券商代理申购、赎回业务可能受到限制、暂停或终止，从而影响投资者申购、赎回。

圆登记结算机构可能调整结算制度，从而对投资者基金份额、资金等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。

猿证券交易所、期货交易所、证券与期货登记结算机构、申购赎回代理券商、基金托管人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。

（十二）管理风险

基金管理人、基金托管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。

（十三）创新风险

本基金是在境内募集和上市交易、投资于境外市场、跟踪境外特定指数的交易型开放式指数基金，涉及到境内、境外两个市场，属于创新基金品种，境外证券交易所、期货交易所、证券与期货登记结算机构的交易规则、业务规则和市场惯例与境内有较大差异，基金管理人和相关市场参与主体涉及跨境业务的处理能力、经验、系统等有待验证，从而导致本基金的运作可能受到影响而带来风险。

二、投资风险

员市场风险：本基金投资于海外市场，面临海外市场波动带来的风险。影响金融市场波动的因素比较复杂，包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波动等，都将影响基金净值的升跌。此外，基金主要投资的香港证券市场对每日证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，因此香港证券市场证券的每日涨跌幅空间相对较大。这一因素可能会带来市场的急剧下跌，从而带来投资风险的增加。

圆政府管制风险：在特殊情况下，基金所投资市场有可能面临政府管制措施，包括对货币兑换进行限制、限制资本外流、征收高额税收等，会对基金投资造成影响。

猿监管风险：由于监管层或监管模式出现非预期的变动，某些已经存在的或者运作的交易可能被新的监管层或监管体系认定为非法交易，或受到更严格的管理，将导致基金运作承受监管风险。基金运作可能被迫进行调整，由此可能对基金净值产生影响。

源政治风险：基金所投资市场因政治局势变化，如政策变化、罢工、恐怖袭击、战争、暴动等，可能出现市场大幅波动，对基金净值产生不利影响。

缘流动性风险：流动性风险指基金在短时间内购买以及售出金融工具，由于市场暂时的供需不平衡和本基金较大的流动性需求，使得市场在交易过程中产生不利的暂时价格变动，增加交易成本和交易难度。当某国[illegible]区的资本市场模较小，金融市场不发达，某金融品种流通市值较低，参与机构数量较少，成交不活跃，以及基金需要在短时间内进行大量交易时，有可能发生流动性风险，导致基金难以及时建仓，或在出现大额赎回时，被迫在不利价格大量抛售证券，使基金净值遭受不利影响。

远汇率风险：本基金投资的海外市场金融品种以外币计价，如果所投资市场的货币相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；此外，外币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

苑利率风险：金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

愿衍生品风险：本基金可投资于期货与期权，以及外汇远期合约等汇率衍生品。尽管本基金将谨慎地使用衍生品进行投资，但衍生品仍可能给基金带来额外风险，包括杠杆风险、交易对手的信用风险、衍生品价格与其基础品种的相关度降低带来的风险等，由此可能会增加基金净值的波动幅度。在本基金中，衍生品将仅用于避险和进行组合的有效管理。

怨金融模型风险：基金管理人有时会使用金融模型来进行资产定价、趋势判断、风险评估等，辅助其做出投资决策。但是金融模型通常是建立在一系列的学术假设之上的，投资实践和学术假设之间存在一定的差距；而且金融模型结论的准确性往往受制于模型使用的数据的精确性。因此，基金管理人在使用金融模型时，面临出现错误结论的可能性，形成投资风险。

（下转D10版）

易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告

基金管理人：易方达基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

重要提示

[illegible]易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集已获中国证监会证监许可（[illegible]）。

[illegible]本基金是交易型开放式指数证券投资基金。

本基金的管理人为易方达基金管理有限公司（以下简称“本公司”），托管人为交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”），境外托管人为香港上海汇丰银行有限公司（简称“汇丰银行”），登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司。

猿[illegible]本基金的发售对象为符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者、合格境外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。

源[illegible]本基金自[illegible]至[illegible]至[illegible]进行发售。投资者可选择网上现金认购和网下现金认购两种方式。其中，通过基金管理人进行网下现金认购的日期为[illegible]至[illegible]，通过发售代理机构进行网下现金认购的日期为[illegible]至[illegible]，网上现金认购的日期为[illegible]至[illegible]。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。

缘[illegible]本基金网上现金发售通过具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司办理。

远[illegible]本基金网下现金发售通过基金管理人指定的销售机构（包括直销机构和发售代理机构）公开发售。

苑[illegible]投资者认购本基金时需具有上海证券交易所[illegible]股账户或上海证券交易所证券投资基金账户。

愿[illegible]网上现金认购单一账户每笔认购份额需为[illegible]或其整数倍，最高不得超过[illegible]。投资者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[illegible]或其整数倍；投资者通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在[illegible]份以上（含[illegible]份）。投资者可以多次认购，累计认购不设上限。

怨[illegible]网上现金认购可多次申报，不可撤单，申报一经确认，认购资金即被冻结。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。

愿[illegible]销售网点（指直销网点和代销网点）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原认购网点查询认购确认情况。

愿[illegible]本公司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[illegible]易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金[illegible]的详细情况，请详细阅读刊登在中国证监会指定信息披露媒体上的《易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

愿[illegible]本基金的招募说明书及本公告将同时发布在本公司网站（[illegible]）。

愿[illegible]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。

愿[illegible]在发售期间，除本公告所列的发售代理机构外，如变更其他网下现金发售代理机构，基金管理人将及时公告。

愿[illegible]本公司可根据基金销售情况适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。

愿[illegible]未开设销售网点的地方的投资者，请拨打本公司的客户服务电话（[illegible]）及直销中心电话（[illegible]）咨询购买事宜。

愿[illegible]基金管理人可综合各种情况对发售安排做适当调整。

愿[illegible]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券商，报上海证券交易所，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券商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券商。

怨[illegible]风险提示

本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的[illegible]%。本基金投资于证券期货市场，基金净值会因为证券期货市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，承担基金投资中可能出现的各类风险。投资本基金可能遇到的主要风险包括：（1）本基金特有的风险，主要包括标的指数的风险、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、基金管理人代理申赎投资者买券卖券的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、退市风险、申购失败的风险、赎回失败的风险、投资者参考[illegible]做出投资决策的风险和[illegible]计算错误的风险、第三方机构服务的风险、管理风险、创新风险等；（2）投资风险，主要包括市场风险等；（3）运作风险，主要包括操作风险等；（4）不可抗力风险；等等。本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金跟踪香港市场股票指数，基金净值会因香港证券市场波动等因素而产生波动，同时面临汇率风险等投资境外市场的特殊风险。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

基金不同于银行储蓄与债券，基金投资者有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

一、本次募集基本情况

[illegible]基金名称

易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金（基金认购代码：[illegible]）

[illegible]基金场内简称

[illegible]股标[illegible]

[illegible]基金的类别

境外股票指数基金

[illegible]基金运作方式

交易型、开放式

[illegible]基金存续期限

不定期

[illegible]基金份额面值

每份基金初始份额面值为[illegible]元人民币。

[illegible]基金投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

[illegible]募集对象

个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者。

[illegible]销售机构和销售地点

[illegible]协调人

[illegible]协调人：广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路[illegible]号大都会广场[illegible]（[illegible]）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场[illegible]

法定代表人：林治海

联系人：黄岚

客户服务电话：[illegible]

开放式基金业务传真：[illegible]

网址：[illegible]

[illegible]副主协调人：中银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路[illegible]号

办公地址：上海市常熟路[illegible]号

法定代表人：丁国荣

联系人：曹晔

联系电话：[illegible]

客户服务电话：[illegible]

传真：[illegible]

网址：[illegible]

[illegible]副主协调人：中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路[illegible]号[illegible]楼

办公地址：北京市朝阳门内大街[illegible]

法定代表人：王常青

联系人：权唐

开放式基金咨询电话：[illegible]

开放式基金业务传真：[illegible]

网址：[illegible]

[illegible]副主协调人：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[illegible]号国际证券大厦[illegible]座

法定代表人：顾伟国

联系人：田薇

客户服务电话：[illegible]

网址：[illegible]

[illegible]副主协调人：国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路[illegible]号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

联系电话：[illegible]

客户服务电话：[illegible]

传真：[illegible]

网址：[illegible]

[illegible]副主协调人：光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路[illegible]

办公地址：上海市静安区新闸路[illegible]

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨、李芳芳

联系电话：[illegible]

客户服务电话：[illegible]

传真：[illegible]

网址：[illegible]

[illegible]网上现金发售代理机构

具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司。

[illegible]网下现金发售直销机构

广州市体育西路[illegible]号城建大厦[illegible]楼易方达基金管理有限公司广州直销中心；

北京市西城区金融街[illegible]号[illegible]座[illegible]层易方达基金管理有限公司北京直销中心；

上海市世纪大道[illegible]号金茂大厦[illegible]至易方达基金管理有限公司上海直销中心。

[illegible]网下现金发售代理机构

广发证券、长城证券、平安证券、信达证券、财通证券、山西证券、东方证券、中航证券、华宝证券、新时代证券。

上述排名不分先后。

如本次募集期间，变更网下现金发售代理机构，将另行公告。

[illegible]募集时间安排与基金合同生效

本基金的募集期限不超过[illegible]个月，自基金份额开始发售之日起计算。

本基金自[illegible]至[illegible]进行发售。投资者可选择网上现金认购和网下现金认购两种方式。其中，通过基金管理人进行网下现金认购的日期为[illegible]至[illegible]，通过发售代理机构进行网下现金认购的日期为[illegible]至[illegible]，网上现金认购的日期为[illegible]至[illegible]。如上海证券交易所或基金管理人对认购时间作出调整，将另行公告。

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

基金发售期期满或基金管理人依据法律法规及发售公告的规定决定停止基金发售时，若本基金达到基金备案条件（即基金募集份额总额不少于[illegible]亿元，基金募集金额不少于[illegible]亿元人民币且基金份额持有人的人数不少于[illegible]人，下同），自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效；若未达到基金备案条件，则本基金将在[illegible]个月的募集期内继续发售。

若[illegible]个月的募集期满，本基金仍未达到基金备案条件，基金管理人应承担全部募集费用，将已募集资金加计同期银行活期存款利息在募集期结束后[illegible]日内退还给认购人。

[illegible]认购期利息的处理方式

通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息，将折算为基金份额归投资者所有，其中利息转份额以基金管理人的记录为准；网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记结算机构清算交收后产生的利息，计入基金财产，不折算为投资者基金份额。

二、认购费用

[illegible]认购费用由投资者承担，不超过认购份额的[illegible]%，认购费率如下表所示：

认购份额	认购费率
[illegible]万份以下	[illegible]
[illegible]万份以上（含）[illegible]万份以下	[illegible]
[illegible]万份以上（含）	员[illegible]元/笔

基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用，投资者申请重复现金认购的，须按每笔认购申请所对应的费率档次分别计费。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。

[illegible]认购费用计算公式与收取方式

（1）通过基金管理人进行网下现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购费用和认购金额的计算公式为：

认购费用[illegible]认购份额[illegible]认购费率

认购金额[illegible]认购份额[illegible]认购费率）

净认购份额[illegible]认购份额[illegible]认购金额产生的利息[illegible]基金份额面值

认购费用由基金管理人在投资者认购申请时收取，投资者需以现金方式交纳认购费用。

例一：某投资者到本公司直销中心认购[illegible]基金份额，认购金额产生的利息为[illegible]，则需准备的资金金额计算如下：

认购费用[illegible]

认购金额[illegible]

净认购份额[illegible]

即投资者若通过基金管理人认购本基金[illegible]份，需准备[illegible]资金，假定该笔认购金额产生利息[illegible]元，则投资者可得到[illegible]本基金基金份额。

[illegible]通过发售代理机构进行网上现金认购、网下现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购佣金和认购金额的计算公式为：

认购佣金