

華夏滬深300指數ETF (股份代號: 83188/3188)

基金月報



截至2017年9月29日

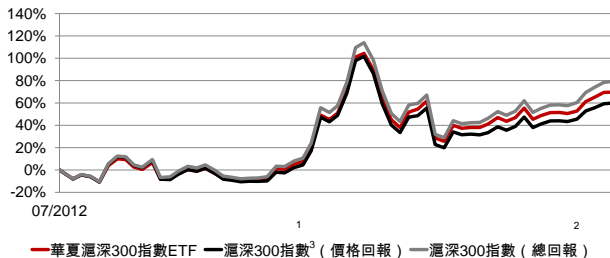
香港中環花園道1號中銀大廈37樓

- 華夏滬深300指數ETF(「本基金」)為一交易所買賣基金,於香港聯合交易所有限公司(「香港聯交所」)上市,透過基金經理獲授予之人民幣合格境外機構投資者(「RQFII」)額度,主要直接投資於滬深300指數成份A股。
- 由於本基金追蹤單一地區(中國)的表現,故面臨集中性風險。投資中國等新興市場涉及的風險更高,例如更高的政治、稅務、經濟、外匯、流通性及規管風險。
- RQFII政策及規則為新訂,有關政策及規則或會變更,該等變動亦可能有追溯效應。RQFII的已投資資金及淨利潤資金返程並不存在任何禁售期,亦毋須取得事前批准,惟無法保證中國的規則及法規日後將不會施加該返程限制。返程的任何新限制,可能影響本基金滿足贖回要求的能力。
- 目前中國有關RQFII於中國投資實現的資本收益之稅務法例涉及不確定性(可能有追溯效應),基金經理目前會就潛在稅務責任為本基金作出某些撥備,若撥備及實際稅務責任之間有差額,將從基金的資產扣減,屆時基金的資產值或會受不利影響。
- 香港聯交所的雙櫃台模式乃屬創新,而本基金為基金單位同時以人民幣及港幣交易的首批交易所買賣基金之一。倘基金單位在港幣櫃台與人民幣櫃台之間的跨櫃台轉換中斷,則基金單位持有人將僅可於相關櫃台買賣其基金單位。港幣買賣基金單位及人民幣買賣基金單位於香港聯交所的市價可能會因市場流通性、各個櫃台的供求情況以及匯率等不同因素而相距甚遠。並無人民幣賬戶的投資者僅可買賣港幣買賣基金單位,而無法買賣人民幣買賣基金單位,並應注意,分派僅以人民幣作出。因此,該等投資者在收取股息時可能會蒙受匯兌虧損或須付匯兌相關費用。並非所有經紀及中央結算系統參與者均能夠執行雙櫃台模式。這可能會導致投資者無法或延遲交易港幣買賣基金單位或人民幣買賣基金單位,而因此僅能以一種貨幣進行交易。
- 本基金以人民幣計值。人民幣目前不可自由兌換,並受外匯管制及約束,無法保證人民幣不會貶值。投資者如有意將本基金支付的贖回所得收益或股息(港幣買賣基金單位及人民幣買賣基金單位均為人民幣)或出售所得收益(人民幣)兌換為不同貨幣,將面臨相關的外匯風險。
- 倘中國經紀或中國託管人執行或結算任何交易時失責,或於中國轉移任何資金或證券時失責,本基金可能延遲收回資產,繼而影響資產淨值。
- 本基金並非「主動式管理」基金,故倘該指數下跌,基金價值亦會下跌。投資者可能損失部份或所有投資。
- 鑑於基金的費用及開支、市場的流通性及基金經理採取的不同投資策略,本基金的回報可能與該指數不同。
- 本基金單位於香港聯交所買賣,香港聯交所之價格以二級市場買賣因素釐定,故基金於香港聯交所之市場價格或會與資產淨值有異。
- 閣下不應僅依賴本資料作出投資決定。於作出投資決定前,請先細閱有關銷售文件,包括風險因素,以得悉本基金詳情。如有需要,閣下應諮詢獨立專業意見。
- 投資涉及風險。基金過往業績並不表示將來亦會有類似的業績。

▲ 投資目標

本基金透過基金經理獲得的人民幣合格境外機構投資者(「RQFII」)額度,以尋求在扣除費用及開支前取得與滬深300指數價格回報接近的投資回報。本基金是RQFII計劃下的實物A股ETF。

▲ 基金表現



最近基金分派

記錄日期	分派 (人民幣)
2017年7月21日	0.33
2016年7月18日	0.3

累積回報

	一個月	六個月	一年	三年	五年	自成立起
華夏滬深300指數ETF ¹	+0.19%	+12.00%	+18.23%	+61.22%	+77.31%	+69.69% ⁷
滬深300指數 (價格回報) ²	+0.38%	+11.01%	+17.93%	+56.53%	+67.31%	+59.87% ⁷
滬深300指數 (總回報) ³	+0.47%	+13.23%	+20.33%	+65.92%	+86.80%	+79.23% ⁷

年度回報

	2012	2013	2014	2015	2016	2017 本年至今
華夏滬深300指數ETF ¹	+3.98% ⁷	-6.73%	+53.79%	+8.41%	-10.06%	+16.68%
滬深300指數 (價格回報) ²	+7.55% ⁷	-7.65%	+51.66%	+5.58%	-11.28%	+15.90%
滬深300指數 (總回報) ³	+9.75% ⁷	-5.33%	+55.84%	+7.23%	-9.25%	+18.25%

¹ 華夏滬深300指數ETF的表現根據基金單位資產淨值對資產淨值計算,包括股息再投資;投資回報以人民幣計值,持美元/港幣的投資者將承擔美元/港幣兌人民幣匯率波動的風險。

² 來源:彭博;滬深300指數表現根據價格回報計算;回報以人民幣計值。

³ 來源:彭博;滬深300指數表現根據總回報計算;回報以人民幣計值。

⁴ 關於基金詳情(包括費用)請參閱基金章程。

⁵ 總開支比率包括管理費,但估計總開支比率並不反映估計追蹤誤差。

⁶ 最新基金單位資產淨值於基金經理的網站<http://etf.chinaamc.com.hk/HKtc/CSI300>公佈。

⁷ 自基金首個官方資產淨值日2012年7月16日起計算。

▲ 基金資料⁴

基金經理	華夏基金(香港)有限公司
受託人	Cititrust Limited
總開支比率 ⁵	預計為每年資產淨值的0.83%
基礎貨幣	人民幣
彭博指數代碼	SHSZ300 Index
總資產	人民幣 10,349.04 百萬元
每基金單位資產淨值 ⁶	人民幣 39.335 元
上市交易所	香港聯合交易所有限公司 - 主板
ETF網站	http://etf.chinaamc.com.hk/HKtc/CSI300

二級市場交易資訊

	人民幣櫃台	港幣櫃台
開始交易日期	2012年7月17日	2012年10月26日
股份代號	83188	3188
交易貨幣	人民幣	港幣
每手買賣單位數目	200個基金單位	200個基金單位
彭博基金代碼	83188 HK Equity	3188 HK Equity
ISIN 編碼	HK0000110269	HK0000123577

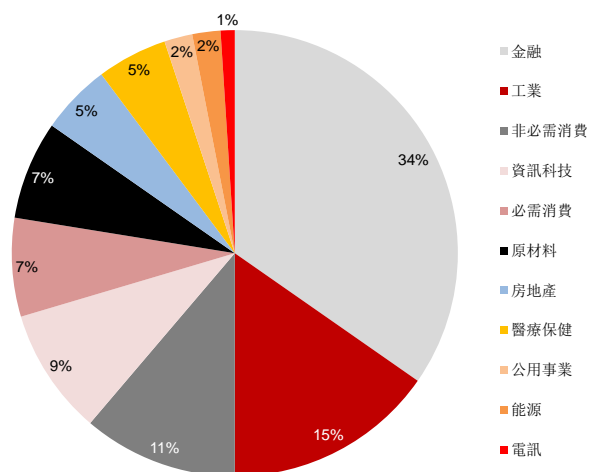
華夏滬深300指數ETF (股份代號: 83188/3188)



關於華夏基金管理有限公司

華夏基金(香港)有限公司的母公司華夏基金管理有限公司(「華夏基金」)是中國內地領先的被動式基金經理。華夏基金於1999年推出增強指數基金,是中國內地首批推出這類產品的基金公司之一,其後更於2004年推出中國內地首隻ETF。華夏基金亦於中國內地管理多隻股票及債券指數基金。

▲ 行業分佈



▲ 十大持倉

名稱	比重
中國平安	5.32%
招商銀行	2.39%
貴州茅臺	2.33%
興業銀行	1.96%
美的集團	1.81%
民生銀行	1.72%
格力電器	1.68%
萬科A	1.62%
交通銀行	1.58%
伊利股份	1.51%

▲ 參與證券商

ABN AMRO Clearing Hong Kong Limited
法國巴黎證券(亞洲)有限公司
中銀國際證券有限公司
中國國際金融香港證券有限公司
招商證券(香港)有限公司
中信証券經紀(香港)有限公司
Credit Suisse Securities (Hong Kong) Limited
德意志證券亞洲有限公司
高盛(亞洲)證券有限公司
國泰君安證券(香港)有限公司
海通國際證券集團有限公司
J.P. Morgan Broking (Hong Kong) Limited
麥格理銀行有限公司
美林遠東有限公司
Morgan Stanley Hong Kong Securities Limited
野村國際(香港)有限公司
法國興業證券(香港)有限公司
香港上海滙豐銀行有限公司
UBS Securities Hong Kong Limited
元大證券(香港)有限公司

▲ 做市商

人民幣櫃台

中銀國際證券有限公司
Bluefin HK Limited
招商證券(香港)有限公司
Commerz Securities Hong Kong Limited
中信里昂證券有限公司
Credit Suisse Securities (Hong Kong) Limited
德意志證券亞洲有限公司
IMC Asia Pacific Ltd.
海通國際證券有限公司
Optiver Trading Hong Kong Limited
UBS Securities Hong Kong Limited

港幣櫃台

法國巴黎證券(亞洲)有限公司
中銀國際證券有限公司
Bluefin HK Limited
Commerz Securities Hong Kong Limited
招商證券(香港)有限公司
Credit Suisse Securities (Hong Kong) Limited
德意志證券亞洲有限公司
Eclipse Options (HK) Limited
海通國際證券有限公司
IMC Asia Pacific Limited
中信里昂證券有限公司
Optiver Trading Hong Kong Limited
UBS Securities Hong Kong Limited
躍鯉研發有限公司

服務熱線: (852) 3406 8686

網站: www.chinaamc.com.hk

電郵: hkfund_services@chinaamc.com

風險預告

投資涉及風險。基金單位可升亦可跌,過往業績並不表示將來基金回報,未來回報不能保證。閣下亦可能損失所投資之本金。本資料並不構成對於任何證券或基金的買賣或進行任何交易之邀約或任何投資建議。本文件只供閣下參考之用,閣下不應倚賴本文件作任何投資決定。本文所載之部份資料或數據是從非關聯之第三方取得的,我們合理地相信該等資料或數據是準確,完整及至所示日期為最新的;華夏基金(香港)有限公司確保準確地再製造該等數據或資料,但並不保證該非關聯之第三方所提供之資料或數據的準確性及完整性。閣下應細閱基金銷售說明書,包括風險因素。如有需要,應諮詢獨立專業意見。本資料之發行人為華夏基金(香港)有限公司。此資料並未被香港證監會所審閱。

中證指數免責聲明

滬深300指數(「指數」)的所有權利歸屬於中證指數有限公司(「中證」)。「CSI 300®」是中證的註冊商標。中證對於指數相關資料的準確性和完整性不存任何明示或暗示的擔保。中證不因指數的任何錯誤對任何人承擔責任(無論是否存在過失),亦無責任就指數的任何錯誤告知任何人。中證對於跟蹤指數的基金不作任何擔保、寄書、銷售或推廣,中證不承擔與此相關的任何責任。

