E FUND 易方達

易方達ETF信託

易方達花旗中國國債5-10年期指數ETF

截至2017年08月31日

重要訊息:

1. 易方達花旗中國國債5-10年期指數ETF (「子基金」)為被動式管理交易所買賣基金，如股票一般在香港聯合交易所有限公司(「香港聯交所」)買賣。投資目標為提供緊貼花旗中國國債5-10年期指數(「該指數」)表現的投資回報(未計費用及開支)。子基金屬於一只直接投資於人民幣計值中國國債，以人民幣計值的實物人民幣合格境外機構投資者(「RQFII」)交易所買賣基金，透過基金經理的RQFII資格投資。
2. 子基金面臨a) 投資風險、b) 集中風險、c) 固定收益投資風險 (包括利率風險、流動性風險、信用下調風險、發行人對手方風險、主權債務風險及估值風險)、d) 與 RQFII 制度有關之風險、e) 基金單位之人民幣買賣及結算風險、f) 雙櫃台風險、g) 與中國 / 單一發行人有關之風險、h) 中國稅項風險、i)人民幣貨幣風險、j) 政府干預及限制風險、k) 被動投資風險、l) 基金經理缺乏經驗及依賴投資顧問之風險、m) 新指數風險、n) 操作及結算風險、o) 交易風險、p) 追蹤誤差風險、q) 依賴做市商之風險及r) 終止風險。
3. 基金經理就子基金自其成立以來至 2014 年 11 月 14 日（包括該日）通過RQFII 買賣A 股所得之已變現資本收益總額作出10%預扣所得稅撥備。基金經理自2014 年 11 月 17 日起，不會就通過滬港通或RQFII 買賣A 股所得之已變現或未變現資本收益總額作出預扣所得稅撥備。關於透過RQFII 額度或滬港通於中國進行投資所變現的資本收益的中國現行稅務法例、規例及做法亦存在風險及不確定因素（可能具有追溯效力）。潛在稅務協定應用亦不確定。子基金於中國的稅務責任可能超過其撥備。撥備與實際稅務責任之間的差額（將從子基金的資產扣除）將對子基金的資產淨值造成不利影響。在這種情況下，由於現有及其後的投資者所承擔的稅務責任與其投資於子基金時的稅務責任比較將會不合比例地偏高，故將不利於現有及其後的投資者。另一方面，實際稅務責任可能低於稅項撥備。在此情況下，於釐定實際稅務責任前已贖回子基金的基金單位的人士將不會享有或獲任何權利就該等超額撥備的任何部分作出申索。
4. 閣下不應僅依賴本資料作出投資決定。於作出投資決定前，請先細閱有關銷售檔，包括風險因素，以得悉子基金詳情。
5. 投資附帶風險。過往業績不代表將來表現。此資料並未被香港證監會審閱。

基金資料

基金經理及RQFII持有人:		易方達資產管理（香港）有限公司
受托人:		滙豐機構信托服務（亞洲）有限公司
托管人:		香港上海滙豐銀行有限公司
香港交易所股份代號:		82808—人民幣櫃台 2808—港幣櫃台
上市日期:		2014年3月14日
交易所:		香港聯交所—主機板
每手買賣單位數目:		10個基金單位
基礎貨幣:		人民幣
交易貨幣:		人民幣 —人民幣櫃台 港幣 —港幣櫃台
管理費:		0.45%
總開支比率:		預計為每年0.50%(包括管理費，受托人費用及其他費用)
投資策略:		代表性抽樣策略
指數彭博代碼:		CFIIC50L <Index>
指數類型:		總回報
每單位資產淨值:		人民幣110.41 —人民幣櫃台 港幣130.86—港幣櫃台
信用評級[1]:		AA-
到期收益率[2]	**指數[3]:**	3.67%
	基金[4]:	3.86%
存續期	**指數[3]:**	6.12年
	基金[4]:	6.60年
凸性	**指數[3]:**	0.46
	基金[4]:	0.53

投資目標

易方達花旗中國國債5-10年期指數ETF(「基金」)以提供緊貼花旗中國國債5-10年期指數表現的投資回報（未扣除費用和開支）為其目標。

基金累積表現[5]

	成立至今[6]	年初至今	1個月	3個月	6個月	1年
基金(人民幣)	10.1%	-3.8%	-0.2%	-0.6%	-1.3%	-5.1%
基金(港幣)	3.4%	2.5%	1.9%	2.4%	3.3%	-2.9%
指數	17.5%	-2.2%	0.0%	0.1%	-1.0%	-2.3%

基金年度累積表現[5]

	2016	2015	2014	2013	2012	2011
基金(人民幣)	0.6%	6.2%	-	-	-	-
基金(港幣)	-4.9%	0.1%	-	-	-	-
指數	2.4%	8.6%	-	-	-	-

資料來源: 彭博資訊 & Wind

1. 信用評級由標準普爾給予債券發行人，截至2017年08月31日。**2.** 到期收益率是指一項債券現金流的當前價值與其市價（包括累計利息）的折讓率。基金的平均到期收益率，是基金個別債券持倉的到期收益率以資產淨值計的加權平均。計算並不包括費用及開支。到期收益率並非基金回報之準則。**3.** 資料來源: Citigroup Index LLC，截至2017年08月31日。**4.** 資料來源: 易方達資產管理（香港）有限公司，截至2017年08月31日。**5.** 基金: 表現以淨資產值對資產淨值，股息(如有)再投資之總回報計算。**6.** 計算自基金成立日(2014年3月14日)至2017年08月31日期間的回報。

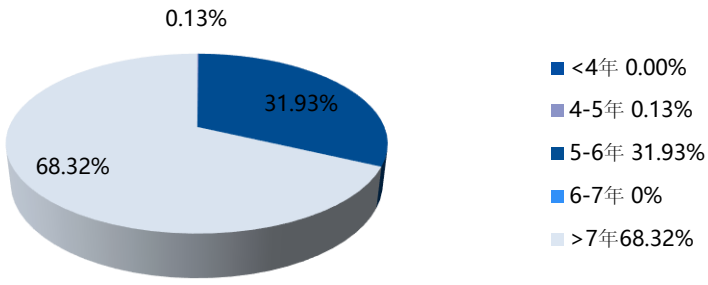
注釋: 過往表現資料並非未來表現的指標，投資者可能無法取回全部投資金額。表現的計算以每個日曆年年底 / 時期期末的資產淨值作為比較基礎，股息(如有)再投資。數字顯示基金價值於所示曆年 / 時期的升幅或跌幅。表現的數據以港幣及人民幣計算,當中包括持續收費,但不包括閣下可能需要支付的認購及贖回費。如未有顯示某年度 / 時期的表現,則指該年度/ 時期未有足夠數據計算表現。基金基準為花旗中國國債5-10年期指數。基金成立日期: 2014年。

易方達花旗中國國債5-10年期指數ETF

基金的所有持倉

種類	票息(%)	到期日	到期收益率(%)	比重（%）
政策性金融債	3.18	2026-04-05	4.41	22.06
國債	2.75	2023-03-17	3.73	8.66
國債	2.90	2026-05-05	3.71	22.72
國債	2.95	2023-06-16	3.69	23.27
國債	2.99	2025-10-15	3.01	23.00
國債	3.36	2022-01-22	3.69	0.12
國債	2.85	2026-01-28	2.85	0.54
國債	3.54	2022-04-16	2.86	0.01
貨幣基金	-	-	-	7.35

基金持倉到期日分佈*



*數據四捨五入至小數點後兩位
基於四捨五入的緣故，到期日分佈的百分比總和不一定等於100%

參與證券商

ABN AMRO Clearing Hong Kong Limited
招商證券（香港）有限公司
中信証券經紀（香港）有限公司
Citigroup Global Markets Asia Limited
廣發證券（香港）經紀有限公司
高盛（亞洲）證券有限公司
海通國際證券有限公司
凱基證券（香港）有限公司
美林遠東有限公司
野村國際（香港）有限公司
法國興業證券（香港）有限公司

莊家/做市商（人民幣櫃台）

海通國際證券有限公司
凱基證券（香港）有限公司

莊家/做市商（港幣櫃台）

海通國際證券有限公司
凱基證券（香港）有限公司

指數供應商免責聲明

© 2017 Citigroup Index LLC 版權所有。CITI 是花旗集團總公司（Citigroup Inc.）或其關係企業註冊之商標及服務標章。於全球各地使用和註冊，並被授權給易方達資產管理(香港)有限公司用於特定用途。易方達花旗中國國債5-10年期指數ETF並非由Citigroup Index LLC（"指數供應商"）贊助、認可、銷售或推薦，且指數供應商不對投資於易方達花旗中國國債5-10年期指數ETF的適合度做出任何聲明或保證。未經指數供應商之事前許可，不得以任何形式重製指數供應商之資料及訊息。儘管指數供應商認為指數資料及訊息是可信賴的，指數供應商不就指數資料及訊息之正確性、合適性、完整性或可用性作出聲明或保證，亦不會就指數資料及訊息之錯誤或遺漏或使用指數資料及訊息之結果負責。指數供應商概不就指數資料作出任何形式之明示或默示保證，包括但不限於就適銷性或適合作特定目的或用途作出任何保證。指數供應商不因使用指數資料引致之任何損害（不論直接或間接、特定性或附隨性）承擔任何責任。

版權所有© 2017。 易方達資產管理(香港)有限公司。

基金獲香港證券及期貨事務監察委員會(「證監會」)認可，但不等於證監會對該基金作出推介或認許，亦不是對該基金的商業利弊或表現作出保證，更不代表該基金適合所有投資者，或認許該基金適合任何個別投資者或任何類別的投資者。投資附帶風險。過往業績不代表將來表現。投資收益以人民幣計算。因此，以港元作出投資的投資者，需承受港元/人民幣兌換率的波動的風險及投資者投資於非當地貨幣之基金時，應注意匯率可引致投資項目的價值或升或跌，導致本金的損失。請參考銷售檔以便獲取基金的其他資料，包括風險因素。此文件並未被證監會審閱。本文件之發行人: 易方達資產管理（香港）有限公司。

本檔不構成投資基金單位之邀請或建議。本檔可能只限於在若干司法權區內派發。在任何不准分發有關資料或作出任何邀請或建議之司法權區內，或向任何人仕分派有關檔或作出邀請或建議即屬違法之情況下，本文件並不構成該等分派或邀請或建議。

易方達資產管理（香港）有限公司
香港中環金融街8號
國際金融中心二期35樓3501-02室 /
香港中環干諾道中41號盈置大廈11樓

查詢電話：(852) 3929 0960
clientservice@efunds.com.hk
www.efunds.com.hk
關注我們：