

香港創富債券指數基金

2018年5月31日

風險披露

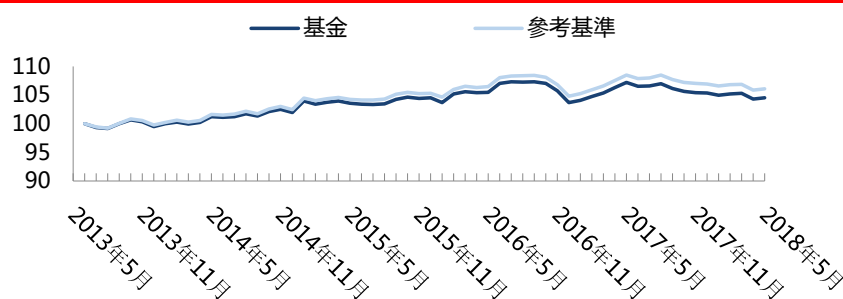
投資涉及風險。投資者衡量是否適合投資本基金時，敬請考慮本身之投資目標及情況。未必所有人都適合投資本基金。如閣下對本文件有任何疑問，應諮詢閣下之股票經紀、銀行經理、律師、會計師或其他財務顧問。投資者應注意：

- 本基金是一項交易所買賣債券基金。本基金在交易所買賣的市場價格或有別於每單位資產淨值。
- 本基金在香港交易所上市並不擔保其流通性及有可能被除牌。
- 本基金主要投資於港元之政府及半政府債券，旨在緊貼相關指數的表現。
- 本基金可從資本中或未扣除開支前撥付股息。派息不獲保證及會導致資本蠶食及資產淨值減少。
- 投資於本基金涉及重大的信貸、對手方、市場、波動性及流動性風險。於動蕩市況下，投資者可能蒙受重大損失。
- 投資者不應僅就此文件提供之資料而作出投資決定，並應細閱本基金之招股章程。
- 基金產品並不等同於定期存款。投資者不應僅就此文件提供之資料作出投資決定。本基金有別於傳統的單位信託基金，投資者應細閱本基金之銷售文件。

基金投資目標及策略

本基金旨在於扣除費用和開支前達致與Markit iBoxx ABF Hong Kong Index的總回報相若的投資表現。

成立至今表現 (%)



基金表現 (%)	年初至今	1個月	3個月	1年	3年 ¹	5年 ¹
基金	-0.79	0.21	-0.66	-2.49	0.93	3.12
參考基準	-0.77	0.24	-0.66	-2.21	1.80	4.59

年度回報表現 (%) ²	2013	2014	2015	2016	2017
基金	-3.51	2.48	2.54	-0.83	1.62
參考基準	-3.02	2.70	2.79	-0.47	2.03

過去的業績並不代表將來的表現。表現以股份類別基本貨幣計算，資產淨值對資產淨值，將股息再作投資，並已扣除費用。如投資業績非以港元或美元計算，以港元或美元作投資的投資者須承受匯率波動的風險。

資料來源：滙豐環球投資管理，數據截至2018年5月31日

基金詳情

UCITS V合規	否
派息類型	派息
派息頻率	每半年
交易頻率	每日
最低初始認購額	Not Applicable
首次認購費最高達	0.00%
管理費	首 15.56 億港元的資產每年收費為 0.15%，其後每年收費為 0.12%
基本貨幣	港元
註冊地	香港
ISIN代號	HK2819031405
股份類別成立日期	2005年6月17日
每股資產淨值	港元 96.76
基金規模	港元 2,781,347,686
彭博代號	2819 HK
參考基準	Markit iBoxx ABF Hong Kong TR HKD
基金經理	Ming Leap

¹當計算期超過一年，業績為累積表現。

²如股份類別成立少於五年，其首年年度表現為成立日至年底。

對本基金表現可能有重大影響的變動：2017年12月11日 - 提高新增單位費用。2018年1月29日 - 更改派息政策。

基金表現以每股淨值計算。本基金在交易所的交易價格可能與每股淨值有所不同。

3年風險衡量指標	基金	參考基準
波幅	2.3%	2.3%
夏普比率	-0.20	-0.08
追蹤誤差	0.2%	-
資訊比率	-1.46	-

5年風險衡量指標	基金	參考基準
波幅	2.4%	2.3%
夏普比率	0.00	0.12
追蹤誤差	0.2%	-
資訊比率	-1.58	-

投資組合特點	基金	參考基準	相差
持倉數量（不包括現金）	61	80	-
平均票息	1.95	1.96	-0.01
有效存續期 ³	4.20	4.20	0.00
投資組合收益率	2.07	2.14	-0.07
平均到期收益率	2.07	2.14	-0.07

投資組合特點	基金	參考基準	相差
現時收益率（未扣除開支）	1.97	1.98	-0.02
平均信貸評級 ⁴	AA+/AA	AA+/AA	-
平均到期日	4.55	4.69	-0.14
發行人數量	9	18	-

信貸評級分佈 (%)	基金	參考基準	相差
AAA	-	1.97	-1.97
AA	97.74	92.22	5.52
A	2.18	0.76	1.42
NR	-	5.05	-5.05
現金	0.08	-	0.08

排序根據評級由高至低，並不包括現金。

行業分佈 (%)	基金	參考基準	相差
國庫券	77.53	75.71	1.82
主權	5.36	3.03	2.33
政府支持機構	5.22	3.36	1.87
工業	5.03	5.70	-0.67
超國家	4.19	7.45	-3.26
金融機構	2.58	4.75	-2.17
現金	0.08	-	0.08

排序根據權重的市值由大至小。

到期日分佈 (有效存續期)	基金	參考基準	相差
Bonds < 1 year	0.01	-	0.01
Bonds 1-2 年	0.44	0.46	-0.03
Bonds 2-3 年	0.23	0.31	-0.08
Bonds 3-4 年	0.54	0.58	-0.04
Bonds 4-5 年	0.53	0.49	0.05
Bonds 5-10 年	1.30	1.26	0.03
Bonds > 10 年	1.15	1.09	0.05
總計	4.20	4.20	0.00

排序根據到期日期限由長至短

³有效存續期並不包括利率期貨、債券期貨以及利率掉期的超額收益。

⁴平均信用質量評級為三大信用評級機構標準普爾，惠譽國際與穆迪投資的平均值。在計算基金與其基準平均質量評級時不包括無評級的證券。

指數免責聲明

Markit、其聯屬機構或任何第三方數據提供者概不就有關數據的準確性、完整性或及時性或獲取有關數據的人士所獲得的結果作出任何明示或暗示的保證。無論原因為何，Markit、其聯屬機構及任何數據提供者概不就Markit數據的任何不準確、錯誤或遺漏或其導致的任何（無論直接或間接）損害向獲取有關數據的任何人士承擔任何責任。如此處所指的任何事項出現變化或隨後變得不準確，Markit並無責任更新、修訂或更改有關數據或通知獲取有關數據的人士。在不局限前述的情況下，Markit、其聯屬機構或任何第三方數據提供者，概不就閣下或任何第三方由於或涉及無論是否基於此處所包含的內容、資訊或材料所作出的任何意見、建議、預測、判斷或任何其他結論，或任何行動而引致的任何損失或損害，向閣下承擔任何責任，不論是否是基於合約（包括賠償）的原則、侵權（包括過失）的行為、保證、法令或其他情況。版權 © 2018，Markit指數有限公司。

重要資訊

本文件只提供一般性資料，並不針對任何可能收到本文件的人士的具體投資目標、財務狀況和特別需求。在此表達之意見可因應情況修改而不作另行通知。本文件並非銷售文件，且不構成建議、要約出售或招攬購買或認購任何投資。本文件所載任何預測、預計或目標僅供說明用途，且並非任何形式的保證。滙豐環球投資管理（香港）有限公司（「滙豐環球投資管理」）就預測、預計或目標未能達成概不承擔任何責任。本文件內的資料乃取自滙豐環球投資管理合理地相信可靠的來源。然而，無論明示或暗示，滙豐環球投資管理不保證、擔保或代表本文件內該等資料的準確性、有效性或完整性。投資附帶風險，過去的業績並不代表將來的表現。請參閱銷售文件以便獲取其它資料，包括風險因素。此文件並未經證券及期貨事務監察委員會批閱。版權 © HSBC Global Asset Management (Hong Kong) Limited（滙豐環球投資管理（香港）有限公司）2018。版權所有。本文件由HSBC Global Asset Management (Hong Kong) Limited（滙豐環球投資管理（香港）有限公司）刊發。

詞彙表

可換股債券，持有人可轉換成發行公司特定數量普通股或等同現金值的一種債券。

企業債券，公司所發行用以融資的債券。

票息，對債券支付的年利率，表現為面值的百分比。

信貸質素，判斷債券或債券互惠基金投資質素的主要準則之一。

發達市場，在經濟和資本市場方面最發達的國家。

存續期，一個量度一項定息投資的價格（本金值）對利率變化的敏感度之數值。

新興市場，此等國家的經濟正經歷快速增長。投資於新興市場通常被認為是風險較高。

政府債券或金邊債券，一種予某國家政府的貸款，以換取定期付款（稱為票息），以及承諾原有投資（本金）將在指定的日期償還。金邊債券為一種予英國政府的貸款。

高收益債券，指認可信貸評級機構給予低信貸評級的定息證券。這些證券被認為是擁有較高的違約風險，但卻可能有較高回報。

信息比率，是一個投資組合的回報高於/低於某個基準相對於此等回報的波動性之比率。

投資級別債券，如其信貸評級為標準普爾的BBB-或以上，或穆迪的Baa3或以上，將被認為是投資級別或IG。

期限，為一項金融投資工具仍未償付的期間。

有效存續期，是根據債券發行人提早贖回的機率計算的存續期值。

夏普比率，作為計算風險調整後回報的衡量指標，並為業內的計算標準。

追蹤誤差，量度一個投資組合追蹤其基準指數的密切程度。

波幅，作為衡量基金的價格變動（上升或下跌）相對基金平均表現的百分比。

到期收益率，一隻債券持有直至到期的預期總回報。

投資組合收益率，一隻債券在發行人實際上並無違約時的最低潛在收益率。

香港創富債券指數基金

補充資料

2018年5月31日

	基本貨幣	派息頻率	除息日	每股股息	年化股息率 (派息不獲保證及可從 股本中分派)
基金	港元	每半年	2018年1月30日	0.570000	1.17%
基金	港元	每半年	2017年7月28日	0.740000	1.49%

以上表格只提供過去12個月內最近的股息資料。派息不獲保證及可從股本中分派，導致資產淨值減少。正股息派發不代表正回報。過去的支付收益率和付款不代表未來的支付收益率和付款 歷史付款可以包括分配的收入和資本。

年化股息率的計算方法：(股息/除息日的基金每股淨值價格) x n

n視乎派息頻率。每年派息為1；每半年派息為2；每季派息為4；每月派息為12。

年化股息率乃基於在有關日期的股息並將股息再作投資計算，可能高於或低過實際全年派息率。