

華夏滬深300指數ETF (股份代號: 83188/3188)

基金月報



截至2020年7月31日

香港中環花園道1號中銀大廈37樓

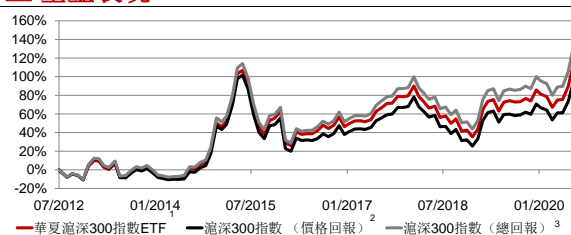
投資涉及風險，包括損失本金。過往表現並不代表未來業績。投資華夏滬深300指數ETF(「本基金」)前，投資者應參閱基金章程，包括細閱風險因素。閣下不應僅依賴本資料作出投資決定。請注意：

- 本基金投資目標為提供緊貼滬深300指數(「該指數」)表現的投資回報(未計費用及開支)。本基金透過基金經理的RQFII配額和股票市場交易互聯互通機制，投資於中國境內證券市場。
- 由於本基金追蹤單一地區(中國)的表現，故面臨集中性風險，其波動可能超過地區覆蓋廣泛的基金。
- 本基金面臨與RQFII制度有關之風險，例如中國經紀或中國託管人執行或結算任何交易或轉讓任何資金或證券時違約，RQFII政策及規則可予以修訂，且實施存在不確定性、人民幣資金返匯限制，以及基金的RQFII額度不足。
- 本基金面臨與股票市場交易互聯互通機制相關的風險，例如規則及法規可能有變動、額度限制、股票市場交易互聯互通機制作交易被暫停。倘基金通過股票市場交易互聯互通機制及投資於中國A股的能力受不利影響，基金經理僅能依賴RQFII投資以達致投資目標。
- 投資於中國等新興市場時，因政治、稅務、經濟、外匯、流通性及監管等風險較高，故虧損風險高於投資於較發達市場。
- 倘基金單位在港幣櫃台與人民幣櫃台之間的跨櫃台轉換因任何原因而中斷，則基金單位持有人將僅可於香港聯交所於相關櫃台的基金單位進行交易。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人民幣與港幣匯率(於在岸及離岸市場)等不同因素而相去甚遠。因此，投資者於香港聯交所購入或出售港幣買賣基金單位時支付的金額可能少於購入或出售人民幣買賣基金單位時支付或收取的金額，反之亦然。並無人民幣賬戶的投資者僅可買賣港幣買賣基金單位，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及產生匯兌相關費用及開支。並非所有經紀及中央結算系統參與者均熟悉或能夠於一個櫃台購買基金單位，之後於另一個櫃台出售基金單位，或進行基金單位的跨櫃台轉換，或同時於兩個櫃台交易基金單位。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，而投資者或因此僅能以一種貨幣進行交易。
- 由於上交所及深交所開市時，基金的基金單位可能尚未定價，故基金投資組合內的證券價值可能會在投資者無法買賣基金的基金單位之日發生變動。如上交所與深交所與香港聯交所的交易時段時差和A股的交易限制都可能擴大基金單位價格相對其資產淨值的溢價/折讓水平。
- 本基金以人民幣計值，人民幣目前不可自由兌換，並受到外匯管制及約束。基礎貨幣並非人民幣的基金單位投資者面臨外匯風險，不保證人民幣兌換投資者的基礎貨幣(如港幣)不會貶值。
- 本基金並非「主動式管理」，故本基金價值可能隨指數下跌而下跌。基金經理不會於跌市中部署防禦性倉位，故投資者可能會於指數下跌時損失其大部分或全部投資。
- 一般而言，散戶投資者僅可於香港聯交所買賣本基金的基金單位，而基金單位於香港聯交所的交易價格受市場因素影響，如基金單位的供求情況。因此，基金單位的交易價格可能會較本基金的資產淨值大幅溢價或折讓。

▲ 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)
2020年7月28日	0.38
2019年7月26日	0.39
2018年7月23日	0.35

累積回報¹

	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	+13.27%	+18.41%	+23.38%	+28.79%	+30.26%	+114.95% ⁷
滬深300指數(價格回報) ²	+12.75%	+17.26%	+22.41%	+25.61%	+23.01%	+95.65% ⁷
滬深300指數(總回報) ³	+13.57%	+19.36%	+25.06%	+34.13%	+36.87%	+133.52% ⁷

年度回報¹

	2015	2016	2017	2018	2019	2020本年至今
華夏滬深300指數ETF ¹	+8.45% ⁷	-10.26%	+22.61%	-24.53%	+37.19%	+15.70%
滬深300指數(價格回報) ²	+5.58% ⁷	-11.28%	+21.78%	-25.31%	+36.07%	+14.61%
滬深300指數(總回報) ³	+7.23% ⁷	-9.25%	+24.25%	-23.64%	+39.19%	+16.66%

¹ 過往表現並不代表未來業績。投資者可能損失所投資之本金。基金表現的計算方法是以前資產淨值對資產淨值計算，包括股息再投資。2017年4月25日起，華夏基金管理公司不再擔任基金投資顧問。基金於2017年4月25日前所達致表現的記錄已不再適用。

² 表現根據價格回報計算；回報以人民幣計價。

³ 表現根據總回報計算；回報以人民幣計價。

⁴ 關於基金詳情(包括費用)請參閱基金章程。

⁵ 總開支比率以截至2019年12月31日止年度的開支為基礎開支，包括管理費、信託費等。該數字不代表跟蹤誤差。

⁶ 最新每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17日起計算。

除非另有說明，資料來源均來自華夏基金(香港)有限公司及彭博。

▲ 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	每年資產淨值的0.82%
基礎貨幣	人民幣
彭博指數代碼	SHSZ300 Index
總資產	人民幣 14,211.19 百萬元
每基金單位資產淨值 ⁶	人民幣 47.9217 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 代碼	HK0000110269	HK0000123577

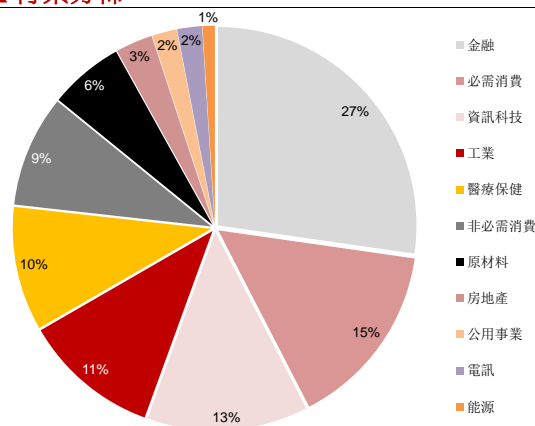
華夏滬深300指數ETF (股份代號：83188/3188)



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
貴州茅臺	5.01%
中國平安	4.89%
五糧液	2.51%
招商銀行	2.13%
美的集團	2.09%
恒瑞醫藥	2.08%
格力電器	1.63%
中信證券	1.52%
伊利股份	1.46%
中信證券	1.41%

▲ 參與證券商

ABN AMRO Clearing Hong Kong Limited
BARCLAYS BANK PLC
BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES
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
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
中泰國際證券有限公司

▲ 做市商

人民幣櫃台	港幣櫃台
中銀國際證券有限公司	法國巴黎證券(亞洲)有限公司
Bluefin HK Limited	中銀國際證券有限公司
Flow Traders Hong Kong Limited	Bluefin HK Limited
IMC Asia Pacific Ltd.	雅柏資本管理(香港)有限公司
Optiver Trading Hong Kong Limited	DRW Singapore Pte. Ltd.
法國興業證券(香港)有限公司	Eclipse Options (HK) Limited
	Flow Traders Hong Kong Limited
	海通國際證券集團有限公司
	IMC Asia Pacific Limited
	聯合證券有限公司
	Optiver Trading Hong Kong Limited
	法國興業證券(香港)有限公司
	Jump Trading Pacific Pte. Ltd.
	盈透證券香港有限公司

注：有關最新莊家名單，請參閱香港交易及結算所有限公司的網址www.hkex.com.hk。

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，未來回報不能被保證。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作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、背書、銷售或推廣，中證不承擔與此相關的任何責任。