

華夏彭博中國國債+政策性銀行債券指數ETF*

(股份代號: 82813/2813/9813)

基金月報



華夏基金(香港)有限公司
CHINA ASSET MANAGEMENT (HONG KONG) LIMITED

截至 2023年07月31日

香港中環花園道1號中銀大廈37樓

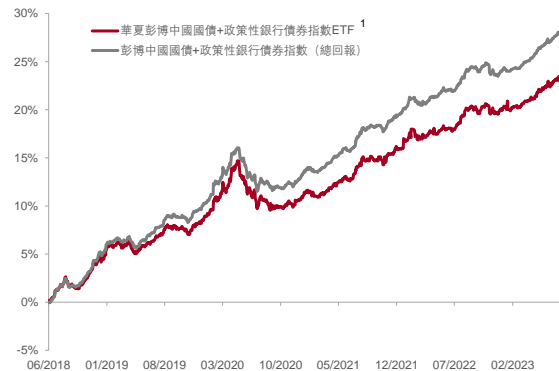
投資涉及風險，包括損失本金。過往表現並不代表未來業績。投資華夏彭博中國國債+政策性銀行債券指數ETF(「本基金」)前，投資者應參閱基金章程，包括細閱風險因素。閣下不應僅依賴本資料作出投資決定。請注意：

- 本基金投資目標為提供緊貼彭博中國國債+政策性銀行債券指數(「該指數」)表現的投資回報(未計費用及開支)。
- 由於本基金追蹤單一地區(中國)的表現及集中投資於少數發行人之債券，故面臨集中性風險，其資產淨值的波動很可能超過覆蓋廣泛的基金。
- 相較於更發達的市場，投資於中國市場或會涉及更高的流動性風險、貨幣風險/管制、政治及經濟不確定性、法律及稅務風險、以及結算和託管風險。
- 本基金面臨債券通外資准入制度有關之風險，例如有關規則及法規可能變更、監管風險、波動風險、流動性風險、結算及交易對手方風險。中國銀行間債券市場的買賣或透過債券通進行交易可能被暫停。
- 本基金面臨投資於債券可能涉及的風險，例如信用/交易對手風險、利率風險、波動及流動性風險、評級下調風險、主權債務風險、估值風險、信貸評級風險、信貸評級機構風險。
- 本基金面臨與中國銀行間債券市場結算程序及交易對手方違約之有關風險。
- 本基金以人民幣計值。人民幣目前不可自由兌換，並受到外匯管制及限制。本基金的基金單位以港幣和美元進行交易。投資者可能需要承擔與外幣波動相關的額外費用或損失。
- 本基金或會面臨追蹤誤差風險。
- 倘基金單位在不同櫃台之間的跨櫃台轉換因任何原因而中斷及/或經紀及中央結算系統參與者之服務受到任何限制，則基金單位持有人將僅可於某一櫃台進行基金單位的交易。基金單位於各個櫃台的市價可能相去甚遠。
- 本基金採用被動式管理，基金經理不會有針對市場變動採取對策的自主性，指數的下跌亦會導致基金價值的下跌。
- 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

本基金的投資目標為提供緊貼彭博中國國債+政策性銀行債券指數表現的投資回報(未扣除費用及開支)。

▲ 基金表現



▲ 基金資料²

基金經理	華夏基金(香港)有限公司		
受託人	HSBC Institutional Trust Services (Asia) Limited		
託管人	香港上海滙豐銀行有限公司		
管理費	每年 0.15%		
基礎貨幣	人民幣		
派息頻率 ⁴	每季		
指數代碼	I32561CN Index		
上市交易所	香港聯合交易所有限公司 - 主板		
ETF網站	https://www.chinaamc.com.hk/zh-hant/product/chinaamc-bloomberg-china-treasury-policy-bank-bond-index-etf-2813-82813-9813-hk/		
二級市場交易資訊			
	美元櫃台	人民幣櫃台	港幣櫃台
開始交易日期	2021年6月30日	2018年6月6日	2018年6月6日
股份代號	9813	82813	2813
交易貨幣	美元	人民幣	港幣
每手買賣單位數目	10個基金單位	10個基金單位	10個基金單位
彭博基金代碼	9813.HK	82813 HK	2813 HK
ISIN 編碼	HK0000744216	HK0000414364	HK0000414356

▲ 累積回報¹

	一個月	六個月	一年	三年	五年	自成立起 ³
華夏彭博中國國債+政策性銀行債券指數ETF	+0.53%	+2.72%	+3.56%	+11.53%	+20.95%	+23.35%
彭博中國國債+政策性銀行債券指數(總回報)	+0.37%	+2.97%	+3.99%	+13.74%	+25.41%	+27.85%

▲ 年度回報¹

	2018 ³	2019	2020	2021	2022	2023本年至今
華夏彭博中國國債+政策性銀行債券指數ETF	+4.89%	+3.87%	+2.26%	+5.02%	+2.65%	+2.71%
彭博中國國債+政策性銀行債券指數(總回報)	+5.42%	+4.63%	+3.03%	+5.72%	+3.34%	+2.97%

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資產淨值對資產淨值計算，包括股息再投資。以上為人民幣櫃台單位的基金回報表現。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。投資組合表現的數據為人民幣櫃台單位。

2 關於基金詳情(包括費用)請參考基金章程。

3 自基金首個官方資產淨值日2018年6月6日起計算。

4 每季派息，惟可由基金經理酌情決定。基金經理擬於計及子基金的淨收入(經扣除費用及成本)後於每年1月、4月、7月及10月向基金單位持有人分派收益。只會於經扣除所有費用及成本後淨收入中支付分派，而不會從子基金的資本中或實際上從資本中支付分派。所有基金單位(不論以人民幣或港幣或美元買賣的基金單位)均將僅以人民幣收取分派款額。

*自2021年8月24日起，基金名稱由華夏彭博巴克萊中國國債+政策性銀行債券指數ETF變更為華夏彭博中國國債+政策性銀行債券指數ETF。

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。

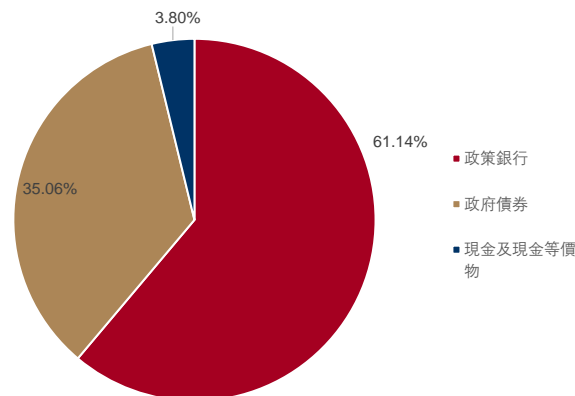
華夏彭博中國國債+政策性銀行債券指數ETF*

(股份代號: 82813/2813/9813)

基金月報



▲ 資產分佈



▲ 產品特點

平均到期收益率 ¹	2.54%
平均派息率	3.26%
平均存續期	5.62年

▲ 存續期分佈

6-10年	60.43%
3-5年	35.77%
現金及現金等價物	3.80%

▲ 五大持倉

名稱	比重
SDBC 4.04 07/06/28	19.58%
SDBC 3.66 03/01/31	19.46%
CGB 3.02 05/27/31	18.87%
CGB 2.85 06/04/27	12.47%
SDBC 3 01/17/32	12.40%

¹使用基金中每個持倉的中位到期收益率加權平均計算。

關於華夏基金(香港)管理有限公司

華夏基金(香港)是華夏基金管理公司的全資子公司,於2008年在香港註冊成立,是首批獲准在港開展資產管理業務的中資基金公司。華夏基金(香港)致力在港發展離岸及跨境資產管理業務,願景成為中國與世界接軌的金融橋樑的中流砥柱之一。目前我們已經建立起涵蓋大中華股票及全球債券公募基金、對沖基金、ETF、杠桿及反向產品和專戶等多元化產品線。我們立足香港,放眼全球,堅持“以客戶為上”的宗旨,致力為大中華區、亞太區、以至歐美等地的個人及機構投資者提供優秀的服務與投資業績。

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。

指數聲明:

「彭博®」及「彭博中國國債+政策性銀行指數」為Bloomberg Finance L.P.及其關係企業(包括指數管理公司—彭博指數服務有限公司(「BISL」)) (統稱「彭博」)的服務商標,且已授權由華夏基金(香港)有限公司用於若干用途。彭博與華夏基金(香港)有限公司並無關聯,且彭博並不會審批、認證、審查或推薦華夏基金(香港)有限公司之政策銀行債券指數ETF。彭博不就華夏基金(香港)有限公司之政策銀行債券指數ETF任何相關資料或資訊之即時性、準確性或完整性作出任何保證。

▲ 參與證券商

ABN AMRO Clearing Hong Kong Limited	越秀證券有限公司
法國巴黎銀行	中泰國際證券有限公司
招商證券(香港)有限公司	
花旗環球金融亞洲有限公司	
國泰君安證券(香港)有限公司	
海通國際證券有限公司	
華泰金融控股(香港)有限公司	
韓國投資證券有限公司	
美林遠東有限公司	
未來資產證券(香港)有限公司	
香港上海滙豐銀行有限公司	

▲ 做市商

人民幣櫃台

Flow Traders Hong Kong Limited

港幣櫃台

Flow Traders Hong Kong Limited

美元櫃台

Flow Traders Hong Kong Limited

註:有關最新做市商名單,請參閱香港交易及結算所有限公司的網址www.hkex.com.hk。