

華夏恒指ESG ETF (股份代號: 3403/83403/9403)

基金月報



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

截至 2024年06月28日

香港中環花園道1號中銀大廈37樓

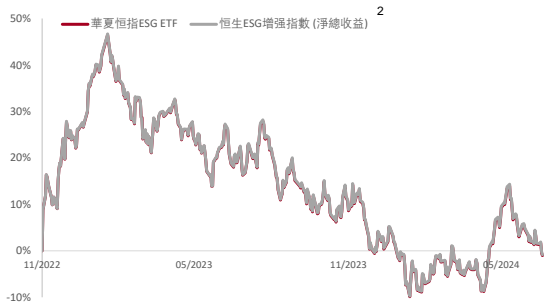
投資涉及風險，包括損失本金。過往表現並不代表未來業績。投資華夏恒指ESG ETF (「本基金」)前，投資者應參閱基金章程，包括細閱風險因素。閣下不應僅依賴本資料作出投資決定。請注意：

- 本基金投資目標為提供緊貼恒指ESG增強指數(「指數」)表現的投資回報(未計費用及開支)。
- 本基金以被動方式管理。指數下跌預期會導致本基金價值相應下跌。
- 本基金投資於股本證券須承受一般市場風險。其價值可能因為各種因素波動。
- 由於指數是一隻新的指數，本基金可能會較其他追蹤具有更長運營歷史指數的交易所買賣基金面臨更高風險。
- 本基金面臨單一地區(大中華)的集中性風險，其波動很可能超過覆蓋廣泛的基金。
- 本基金面臨與ESG相關的風險，例如ESG篩選條件影響投資表現、ESG集中性、不完整、不正確或缺乏ESG數據和評估、缺乏ESG分類標準等。
- 本基金涉及證券借貸交易風險，包括借用人可能無法按時或甚至根本不能歸還證券。
- 上市和非上市類別遵循不同的定價和交易安排。由於費用和成本不同，每個類別的每單位資產淨值可能會有所不同。上市和非上市類別的交易截止時間有所不同。聯交所適用於二級市場的上市類別交易時間與一級市場的上市類別或非上市類別的交易截止時間也不同。
- 上市類別基金單位以當日市場價格在二級市場進行交易，而非上市類別基金單位則通過中介機構根據交易日結束的日終資產淨值出售。非上市類別的投資者可以按資產淨值贖回其單位，而二級市場上市類別的投資者只能按現行市場價格賣出，並且可能必須以大幅折價退出本基金。非上市類別的投資者與上市類別的投資者相比可能處於優勢或劣勢。
- 上市基金單位交易價格受市場因素影響，如基金單位的供求情況。因此，上市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。
- 本基金涉及跟蹤誤差風險。
- 倘上市基金單位在各個櫃檯之間的跨櫃檯轉換暫停，和/或因證券經紀和中央結算系統參與者的服務有任何限制，單位持有人將只可在一個櫃檯交易其基金單位。在各櫃檯交易的上市基金單位市價或會有很大偏差。
- 基金單位持有人只會以港幣收取分派。無港幣賬戶的基金單位持有人或須承擔外匯兌換所涉及的費用及開支。
- 本基金可能酌情從本基金的資本中或實際從資本中支付股息。從資本中或實際從資本中支付分派金額，相當於退還或提取基金份額持有人部分原有之投資或任何歸屬於該原有投資的資本收益。任何該等分派可導致基金的每單位資產淨值即時減少。

▲ 投資目標

本基金投資目標為提供緊貼恒指ESG增強指數表現的投資回報(未扣除費用及開支)。

▲ 基金表現¹



最近基金分派⁵

從資本中派息	分派(港幣)
2024年06月19日	0.35

累積回報¹

	一個月	六個月	一年	叁年	五年	自成立起 ⁴
華夏恒指ESG ETF ¹	-3.96%	-5.79%	-16.81%	-	-	-2.42%
恒生ESG增強指數(淨總收益) ²	-3.97%	-5.78%	-16.78%	-	-	-2.26%

年度回報¹

	2022 ⁴	2023	2024年至今
華夏恒指ESG ETF ¹	+25.44%	-17.52%	-5.79%
恒生ESG增強指數(淨總收益) ²	+25.70%	-17.47%	-5.78%

▲ 基金資料³

基金經理	華夏基金(香港)有限公司		
受託人	滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司		
管理費	每年0.15%		
基礎貨幣	港元		
派息頻率 ⁵	每季		
彭博指數代碼	HSIESGSN		
總資產	港元7,391.12百萬		
每基金單位資產淨值	35.7318		
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-hsi-esg-etf-3403-hk-83403-hk-9403-hk/		
二級市場交易資訊			
開始交易日期	2022年11月10日	2022年11月10日	2022年11月10日
股份代號	3403	83403	9403
交易貨幣	港元	人民幣	美元
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	3403 HK Equity	83403 HK Equity	9403 HK Equity
ISIN 編碼	HK0000873676	HK0000873684	HK0000873692

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。從2023年12月4日開始，指數方法論已經改變，將主要上市的外國公司納入指數範圍。在2023年12月4日之前，子基金的表現是在不再適用的情況下實現的。

²表現根據淨總回報計算，以港幣計算。

³關於基金詳情(包括費用)請參考基金章程。

⁴自基金首個官方資產淨值日2022年11月9日起計算。

⁵基金經理擬於計及基金的淨收入(經扣除費用及成本)後每季(通常於每年度的3月份、6月份、9月份及12月份)向基金單位持有人分派收益，惟可由基金經理酌情決定。派息分配不能保證。從資本中或實際從資本中支付分派金額，相當於退還或提取基金份額持有人部分原有之投資或任何歸屬於該原有投資的資本收益。任何該等分派可導致基金的每單位資產淨值即時減少。派息僅以基準貨幣支付。基金單位持有人可能必須承擔與將此類分派從港幣轉換為美元或任何其他貨幣相關的費用。投資者應參閱基金章程及產品資料概要以獲得更多詳細說明。

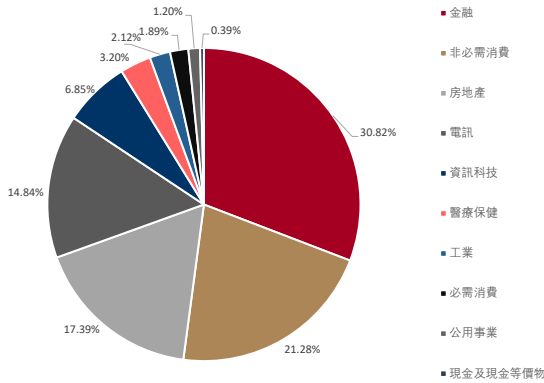
除非另有說明，資料來源均來自華夏基金(香港)有限公司及彭博。

華夏恒指ESG ETF (股份代號: 3403/83403/9403)

基金月報



▲ 行業分佈



▲ 參與證券商

ABN AMRO Clearing Hong Kong Limited
Barclays Bank PLC
法國巴黎銀行
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
花旗環球金融亞洲有限公司
中信里昂證券有限公司
星展唯高達香港有限公司
高盛(亞洲)證券有限公司
海通國際證券有限公司
韓國投資證券亞洲有限公司
Merrill Lynch Far East Limited
未來資產證券(香港)有限公司
Morgan Stanley Hong Kong Securities Limited
香港上海滙豐銀行有限公司
UBS Securities Hong Kong Limited
華盛資本証券有限公司
越秀証券有限公司
中泰國際證券有限公司

▲ 做市商

港幣櫃台
招商證券(香港)有限公司
Flow Traders Hong Kong Limited
匯豐證券經紀(亞洲)有限公司
Jane Street Asia Trading Limited
Optiver Trading Hong Kong Limited
Jump Trading Hong Kong Limited
Vivienne Court Trading Pty. Ltd.
人民幣櫃台
招商證券(香港)有限公司
Flow Traders Hong Kong Limited
Jane Street Asia Trading Limited
Vivienne Court Trading Pty. Ltd.
Optiver Trading Hong Kong Limited
美元櫃台
Flow Traders Hong Kong Limited
Jane Street Asia Trading Limited
Vivienne Court Trading Pty. Ltd.
Optiver Trading Hong Kong Limited

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

▲ 十大持倉

名稱	比重
騰訊控股有限公司	9.53%
香港交易及結算所有限公司	7.11%
友邦保險控股有限公司	7.07%
中國平安保險(集團)股份有限公司	5.35%
小米集團	4.91%
匯豐控股有限公司	4.55%
新鴻基地產發展有限公司	4.27%
領展房地產投資信託基金	4.26%
美團	4.20%
安踏體育用品有限公司	3.30%

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開資管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:

「恒指 ESG 增強指數」的商標及名稱由恒生資訊服務有限公司全權擁有。恒生指數公司及恒生資訊服務有限公司已同意華夏基金(香港)有限公司(「管理人」)可就華夏恒指 ESG ETF(「本基金」)使用及參考恒指 ESG 增強指數。但是, 恒生指數公司及恒生資訊服務有限公司並不就恒指 ESG 增強指數及其計算或任何與之有關的數據的準確性或完整性, 而向任何其他人士作出保證或聲明或擔保, 也不會就恒指 ESG 增強指數提供或默示任何保證、聲明或擔保。恒生指數公司及恒生資訊服務有限公司不會因管理人就該本基金的使用及/或參考恒指 ESG 增強指數, 或恒生指數公司在計算恒指 ESG 增強指數時的任何失準、遺漏或錯誤導致任何人因上述原因而直接或間接蒙受的任何經濟或其他損失承擔任何責任或債務。任何就該本基金進行交易的人士不應依賴恒生指數公司及/或恒生資訊服務有限公司, 亦不應以任何形式向恒生指數公司及/或恒生資訊服務有限公司進行任何索償或法律訴訟。為免疑慮, 本免責聲明不構成任何經紀或就該本基金進行交易的其他人士與恒生指數公司及/或恒生資訊服務有限公司之間的任何合約或準合約關係, 也不應視作已構成這種關係。