

華夏滬深300指數ETF (股份代號：83188/3188)

基金月報



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

截至 2024年07月31日

香港中環花園道1號中銀大廈37樓

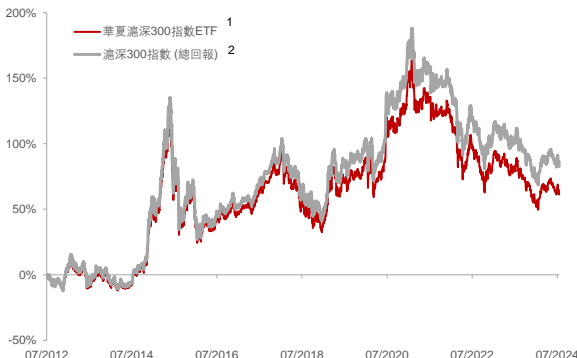
投資涉及風險，包括損失本金。過往表現並不代表未來業績。投資華夏滬深300指數ETF(「本基金」)前，投資者應參閱基金章程，包括細閱風險因素。閣下不應僅依賴本資料作出投資決定。請注意：

- 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和滬港通，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，其波幅很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，例如規則及法規可能有變動、中國經紀或中國託管人執行或結算交易時違約、資金返程限制。
- 本基金面臨與滬港通相關的風險，例如規則及法規可能有變動、額度限制、滬港通機制被暫停。
- 投資於中國時，其政治、稅務、經濟、外匯、流通性、法律及監管等風險較高。
- 倘基金單位在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港交所於相關櫃台的基金單位進行交易。於不同櫃台買賣基金單位於港交所的市價可能會因不同因素而相去甚遠。因此，投資者於港交所購入或出售港幣買賣基金單位時支付的金額可能超過而收取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。
- 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港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。
- 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。
- 從資本中支付分派股息或實際上從資本中支付分派相當於退還或提取投資者部分原本投資的金額或歸屬於該金額的資本收益。任何該等分派可導致基金的每單位資產淨值即時減少。
- 本基金或會面臨追蹤誤差風險。
- 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。
- 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)。

▲ 基金表現



▲ 基金資料³

基金經理	華夏基金(香港)有限公司
受託人	Cititrust Limited
總開支比率 ⁴	每年 0.82%
管理費	每年 0.70%
基礎貨幣	人民幣
彭博指數代碼	SHS300 Index
總資產	人民幣 12,093.80 百萬
每基金單位資產淨值 ⁵	人民幣 35.4865 元
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-csi-300-index-etf-3188-hk-83188-hk/>

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 編碼	HK0000110269	HK0000123577

累積回報¹

	一個月	三個月	六個月	一年	三年	五年 ⁶
華夏滬深300指數ETF ¹	+0.40%	-2.78%	+8.86%	-12.80%	-25.33%	-5.00%
滬深300指數(總回報) ²	+0.60%	-2.38%	+9.56%	-11.85%	-22.93%	+0.47%

年度回報¹

	2019	2020	2021	2022	2023	2024年至今
華夏滬深300指數ETF ¹	+37.19%	+28.16%	-4.52%	-20.58%	-10.11%	+1.97%
滬深300指數(總回報) ²	+39.19%	+29.89%	-3.52%	-19.84%	-9.14%	+2.67%

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。2021年11月8日起，基金的投資策略已經變更。2021年11月8日以前所導致表現的環境已不再適用。投資組合表現的數據為人民幣櫃台單位。

²表現根據總回報計算；回報以人民幣計值。

³關於基金詳情(包括費用)請參考基金章程。

⁴總開支比率以截至2023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。

⁵最新每基金單位資產淨值於基金經理的網站<https://www.chinaamc.com.hk/zh-hant/product/chinaamc-csi-300-index-etf-3188-hk-83188-hk/>公佈。

⁶自基金首個官方資產淨值日2012年7月16日起計算。

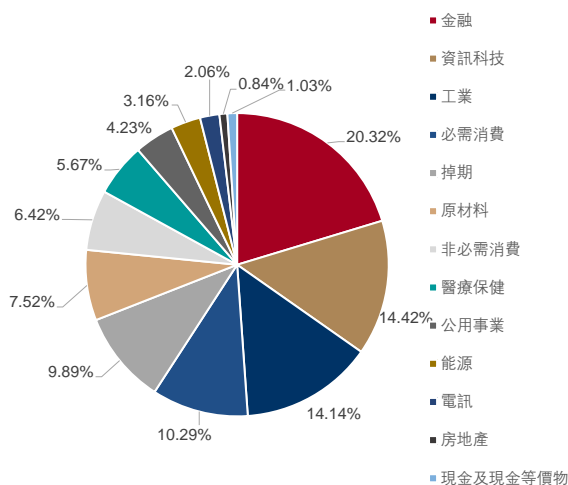
除非另有說明，資料來源均來自華夏基金(香港)有限公司及彭博。

華夏滬深300指數ETF (股份代號 : 83188/3188)

基金月報



▲ 行業分佈



▲ 十大持倉

名稱	比重
CSIN0300	9.89%
貴州茅臺酒股份有限公司	4.47%
寧德時代新能源科技股份有限公司	2.48%
中國平安保險 (集團) 股份有限公司	2.32%
招商銀行股份有限公司	2.05%
中國長江電力股份有限公司	1.85%
美的集團股份有限公司	1.58%
紫金礦業集團股份有限公司	1.38%
宜賓五糧液股份有限公司	1.24%
興業銀行股份有限公司	1.23%

▲ 參與證券商

ABN AMRO Clearing Hong Kong Limited

巴克萊銀行

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

花旗環球金融亞洲有限公司

瑞士信貸證券(香港)有限公司

高盛(亞洲)證券有限公司

國泰君安證券(香港)有限公司

海通國際證券有限公司

華泰金融控股(香港)有限公司

J.P. Morgan Broking (Hong Kong) Limited

韓國投資證券亞洲有限公司

美林遠東有限公司

未來資產證券(香港)有限公司

摩根士丹利香港證券有限公司

野村國際(香港)有限公司

星展唯高達香港有限公司

香港上海匯豐銀行有限公司

瑞銀證券香港有限公司

元大證券(香港)有限公司

越秀證券有限公司

中泰國際證券有限公司

▲ 做市商

人民幣櫃台

Flow Traders Hong Kong Limited

IMC Asia Pacific Ltd.

Jane Street Asia Trading Limited

Mirae Asset Securities Co., Ltd

Optiver Trading Hong Kong Limited

港幣櫃台

Eclipse Options (HK) Limited

Flow Traders Hong Kong Limited

IMC Asia Pacific Limited

盈透證券香港有限公司

Jane Street Asia Trading Limited

Jump Trading Pacific Pte. Ltd.

Mirae Asset Securities Co., Ltd

Optiver Trading 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。

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投資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。

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”)。CSI300®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。