

## 恒生前海中证质量成长低波动指数证券投资基金 基金产品资料概要（更新）

编制日期：2021年3月25日

送出日期：2021年3月31日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。  
作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

### 一、产品概况

基金简称	恒生前海中证质量成长低波动指数	基金代码	006143
下属分级基金的基金简称	恒生前海中证质量成长低波动指数A		恒生前海中证质量成长低波动指数C
下属分级基金的基金代码	006143		006144
基金管理人	恒生前海基金管理有限公司	基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金合同生效日	2019-06-05	上市交易所及上市日期	-
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	杨伟	开始担任本基金基金经理的日期	2019-06-05
		证券从业日期	2009-07-01

### 二、基金投资与净值表现

#### （一）投资目标与投资策略

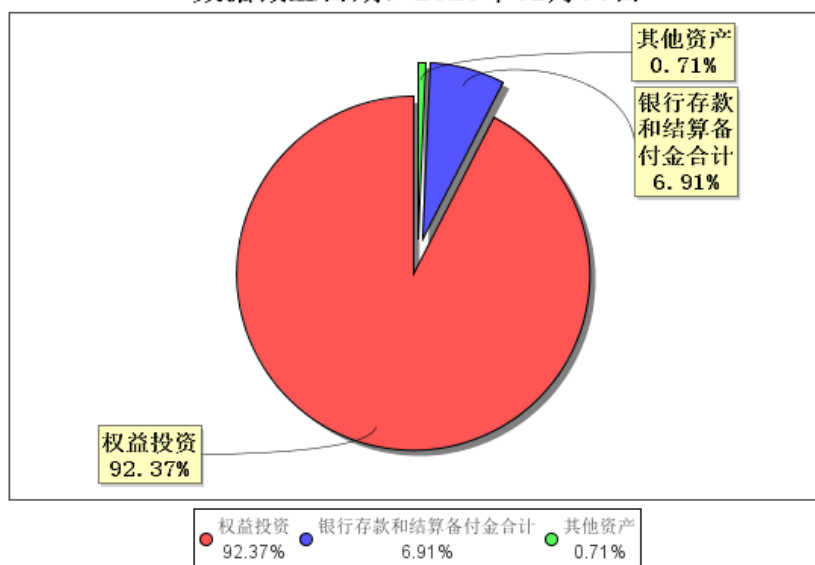
投资者阅读《招募说明书》第十一章了解详细情况

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪标的指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。
投资范围	<p>本基金的投资范围包括标的指数（中证质量成长低波动指数）成份股及备选成份股（均含存托凭证）、其他非成份股（包括中国证监会核准发行并上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%且不低于非现金基金资产的80%。现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</p> <p>如法律法规或监管机构以后变更基金投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。</p>

<b>主要投资策略</b>	<p>本基金采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p>
<b>业绩比较基准</b>	<p>中证质量成长低波动指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%</p>
<b>风险收益特征</b>	<p>本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p>

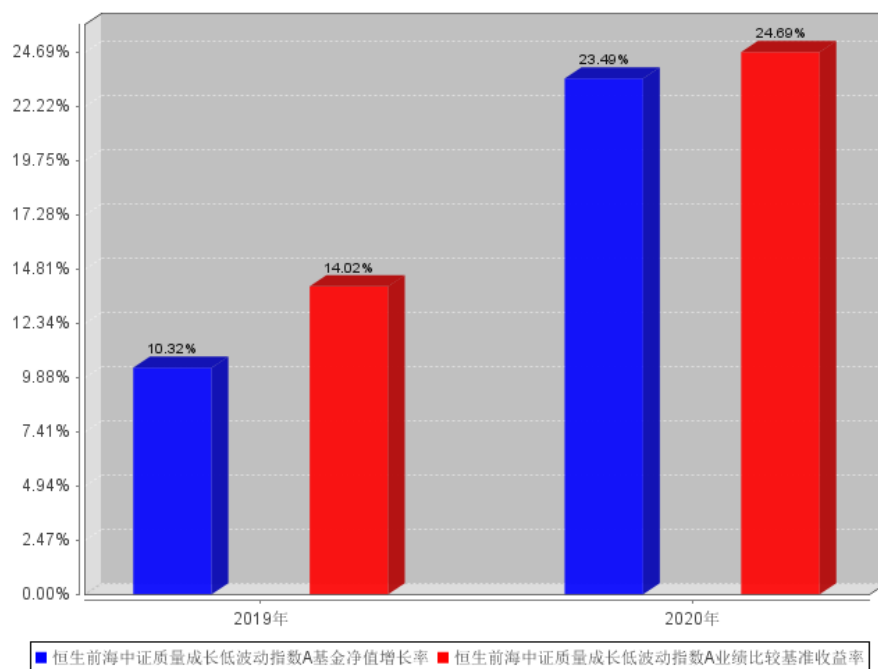
## （二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表  
数据截止日期：2020年12月31日

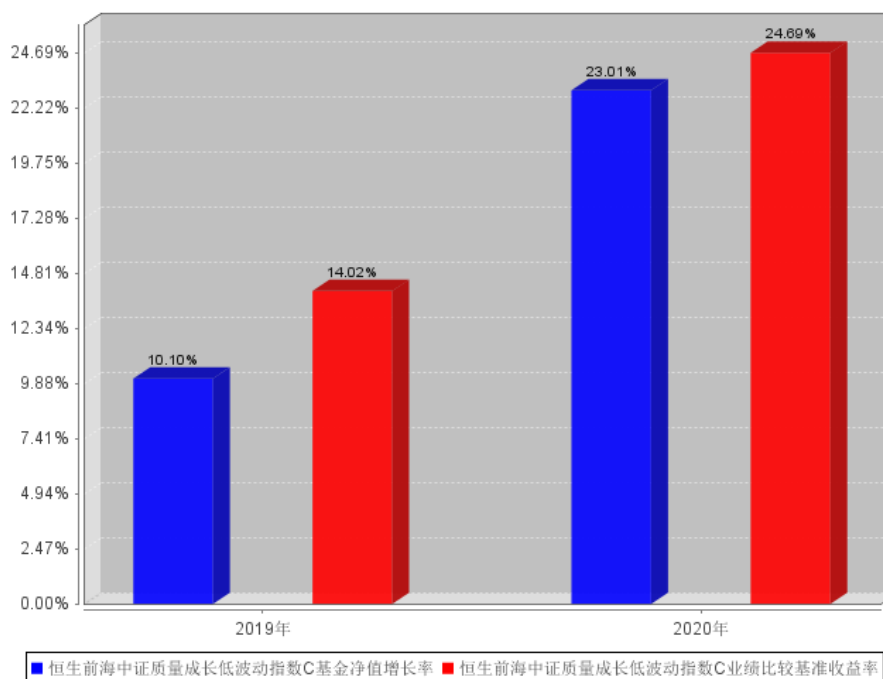


### （三）自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

恒生前海中证质量成长低波动指数A自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



恒生前海中证质量成长低波动指数C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



业绩表现截至日期2020年12月31日。基金过往业绩不代表未来表现。

### 三、投资本基金涉及的费用

#### （一）基金销售相关费用

以下费用在申购/赎回基金过程中收取：

恒生前海中证质量成长低波动指数 A

费用类型	金额（M）/持有期限（N）	收费方式/费率	备注
------	---------------	---------	----

申购费（前收费）	M<100万	1.2%	非特定投资群体
	100万≤M<300万	0.8%	非特定投资群体
	300万≤M<500万	0.4%	非特定投资群体
	500万≤M	1000元/笔	非特定投资群体
	M<100万	0.12%	特定投资群体
	100万≤M<300万	0.08%	特定投资群体
	300万≤M<500万	0.04%	特定投资群体
	500万≤M	1000元/笔	特定投资群体
赎回费	N<7 日	1.5%	-
	7 日≤N<30 日	0.1%	-
	N≥30 日	0%	-

恒生前海中证质量成长低波动指数 C

费用类型	金额（M）/持有期限（N）	收费方式/费率	备注
申购费（前收费）	-	-	不收取申购费用
赎回费	N<7日	1.5%	-
	7 日≤N<30日	0.5%	-
	N≥30日	0%	-

## （二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率	
管理费	0.60%	
托管费	0.15%	
销售服务费	恒生前海中证质量成长低波动指数A	0.00%
	恒生前海中证质量成长低波动指数C	0.40%
指数使用费	0.02%	
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用，《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、审计费、律师费、诉讼费和仲裁费，基金份额持有人大会费用，基金的证券交易费用，基金的银行汇划费用，基金相关账户的开户和维护费用，按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。	

注：1、标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币5万元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

2、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

## 四、风险揭示与重要提示

### （一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失本金。投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

本基金的风险包括：市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、操作风险、特有风险、资产支持证券投资风险、流通受限证券投资风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价

可能不一致的风险、其他风险等。其中作为特有风险包括：

#### 1、作为指数基金存在的风险

本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%，业绩表现将会随着标的指数的波动而波动；同时本基金在多数情况下将维持较高的股票仓位，在股票市场下跌的过程中，可能面临基金净值与标的指数同步下跌的风险。

##### （1）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险。

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

##### （2）标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

##### （3）标的指数变更的风险

根据基金合同规定，如发生导致标的指数变更的情形，基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更本基金的标的指数。若标的指数发生变更，本基金的投资组合将相应进行调整。届时本基金的风险收益特征可能发生变化，且投资组合调整可能产生交易成本和机会成本。投资者须承担因标的指数变更而产生的风险与成本。

##### （4）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

1）由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差；

2）由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差；

3）成份股派发现金红利、配送等所获收益导致基金收益率偏离标的指数收益率，从而产生跟踪偏离度和跟踪误差；

4）由于成份股停牌、摘牌或因标的指数流通市值过小、流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差；

5）由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差；

6）在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度；

7）其他因素，如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因基金分红带来的证券买卖价格波动、证券交易成本、基金仓位变动等；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

##### （5）跟踪误差控制未达约定目标的风险

在正常市场情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

##### （6）标的指数值计算出错的风险

尽管指数供应商将采取一切必要措施以确保指数的准确性，但不对此作任何保证，亦不因指数的任何错误对任何人负责。因此，如果标的指数值出现错误，投资人参考指数值进行投资决策，则可能导致损失。

##### （7）成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时可能面临如下风险：

1) 基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

2) 若成份股停牌时间较长，在约定时间内仍未能及时买入或卖出的，基金可能面临基金资产不能及时买入指数成份股以跟踪标的指数表现，或者不能及时卖出指数成份股转变成现金以应付可能出现的投资人大额赎回的风险，由此可能影响投资者的投资损益并导致基金跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

(8) 指数供应商停止服务的风险

本基金的标的指数由指数供应商发布并管理和维护，未来指数供应商可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数供应商停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前，基金管理人应按照指数供应商提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

2、存托凭证投资风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

## （二）重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

本基金的争议解决处理方式为仲裁。具体仲裁机构和仲裁地点详见本基金合同的具体约定。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站 [www.hsqhunds.com]、客服电话 [400-620-6608]

1. 基金合同、托管协议、招募说明书
2. 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
3. 基金份额净值
4. 基金销售机构及联系方式
5. 其他重要资料

## 六、其他情况说明

-