

华安 CES 港股通精选 100 交易型开放式指数证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 5 月 21 日

送出日期：2024 年 6 月 28 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	华安 CES 港股通精选 100ETF	基金代码	513900
基金管理人	华安基金管理有限公司	基金托管人	中国农业银行股份有限公司
基金合同生效日	2018 年 4 月 27 日	上市交易所及上市日期	上海证券交易所 2018 年 5 月 25 日
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	倪斌	开始担任本基金基金经理的日期	2018 年 9 月 10 日
		证券从业日期	2010 年 7 月 1 日
其他	场内简称		港股 100 (扩位简称: 港股通 100ETF)

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

详情请阅读《招募说明书》中“基金的投资”章节的相关内容。

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资范围	<p>本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括港股通标的股票和中国证监会核准发行的股票、存托凭证）、国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、权证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>本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。</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比例不低于基金资产净值的 90%。权证、股指期货及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>如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。</p> <p>本基金标的指数为中华交易服务港股通精选 100 指数。</p>

本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

主要投资策略

- 1、组合复制策略
- 2、替代性策略
- 3、股指期货投资策略
- 4、债券投资策略
- 5、资产支持证券投资策略
- 6、权证投资策略
- 7、融资及转融通证券出借业务投资策略
- 8、存托凭证投资策略

业绩比较基准

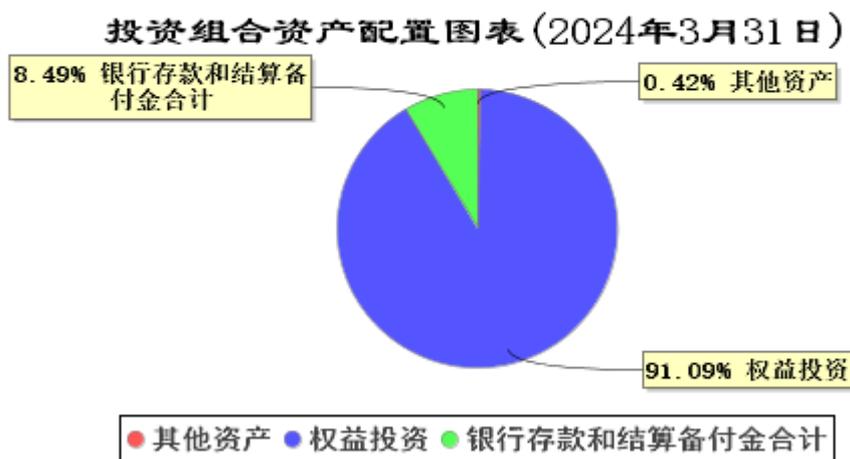
中华交易服务港股通精选 100 指数收益率（经汇率调整）

风险收益特征

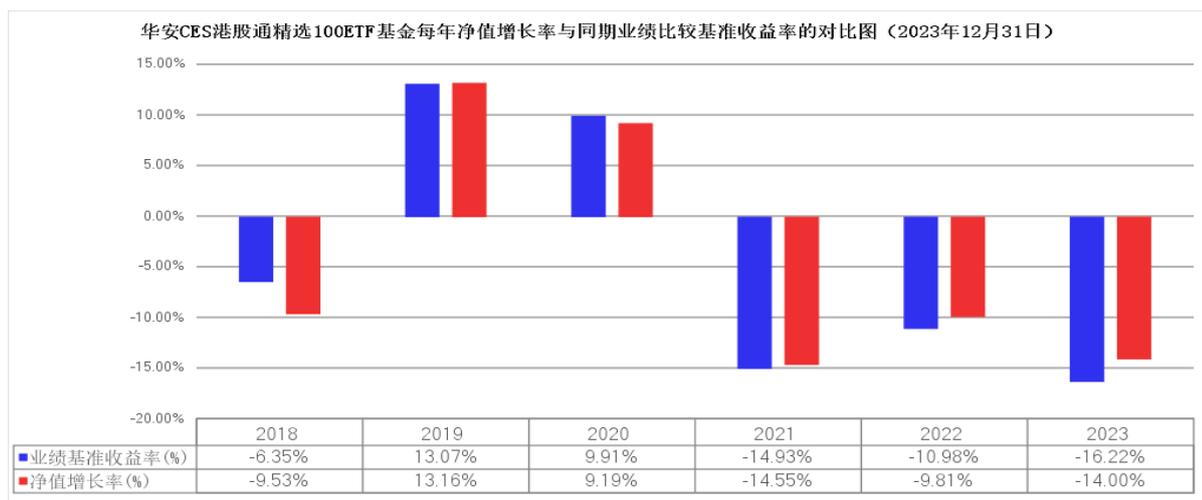
本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金主要通过港股通机制投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



(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



注：基金合同生效当年不满完整自然年度的，按实际期限计算净值增长率，基金的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

投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照一定标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

(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/年费率或金额	收取方
管理费	0.60%	基金管理人和销售机构
托管费	0.10%	基金托管人
审计费用	50,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	120,000.00 元	规定披露报刊
指数许可使用费	指数使用费按前一日基金资产净值的 0.04% 的年费率计提，且收取下限为每季度人民币 5 万元，当季标的指数使用费不足 5 万元的，按照 5 万元支付。不满一个季度的，根据实际使用天数支付。	指数编制公司
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的律师费、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、基金的相关账户的开户费用、账户维护费用等费用，以及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。费用类别详见本基金《基金合同》及《招募说明书》或其更新。	

注：1、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。

2、审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

(三) 基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

基金运作综合费率（年化）
0.93%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

四、风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

（一）本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。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。

（二）本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：市场风险、管理风险、流动性风险、合规性风险、操作和技术风险、本基金的特定风险等等。

（三）本基金的特定风险

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、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

由于标的指数调整成份股或变更编制方法、标的指数成份股发生配股或增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化、成份股派发现金红利、新股市值配售、成份股停牌或摘牌、流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合以及与基金运作相关的费用等因素使本基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

4、跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年跟踪误差控制在 2% 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。

5、成份股停牌的风险

6、成份股退市的风险

7、指数编制机构停止服务的风险

8、港股投资风险

9、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

10、IOPV 计算错误的风险

11、退市风险

12、投资者申购失败的风险

13、投资者赎回失败的风险

14、基金份额赎回对价的变现风险

15、股指期货等金融衍生品投资风险

16、基金投资回报与标的指数回报偏离的风险

17、资产支持证券投资风险

18、存托凭证的投资风险

（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做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、诚实守信、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，也不得保证最低收益。

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。

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据当时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。

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.huaan.com.cn；客户服务电话：40088-50099

- （一）基金合同、托管协议、招募说明书
- （二）定期报告、包括基金季度报告、中期报告、年度报告
- （三）基金份额净值
- （四）基金销售机构及联系方式
- （五）其他重要资料