

# 华夏上证3-5年期中高级可质押信用债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：2021年1月29日

送出日期：2021年2月1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	华夏 3-5 年中高级可质押信用债 ETF	基金代码	511280
基金管理人	华夏基金管理有限公司	基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金合同生效日	2018-05-03	上市交易所及上市日期	上海证券交易所 2018-05-31
基金类型	债券型	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	刘薇	开始担任本基金基金经理的日期	2021-01-27
		证券从业日期	2013-01-14
其他	场内简称：中期信用（扩位证券简称：中期信用 ETF）		
其他	申赎代码：511281		

### 二、基金投资与净值表现

#### (一) 投资目标与投资策略

投资目标	本基金将紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争本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的绝对值不超过0.25%，年化跟踪误差不超过3%。
投资范围	本基金的标的指数为上证3-5年期中高级可质押信用债指数。本基金主要投资于标的指数成份券和备选成份券。为了更好地实现投资目标，本基金还可以投资于依法上市的债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、衍生工具（国债期货等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 基金的投资组合比例为：建仓之后，本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的资产比例不低于基金资产净值的80%，且不低于非现金基金资产的80%。
主要投资策略	本基金为被动管理基金，主要采用代表性分层抽样复制策略，投资于标的指数中具有代表性的部分成份券，或选择非成份券作为替代，使得债券投资组合的总体特征（如久期、剩余期限分布和到期收益率等）与标的指数相似。此外，本基金还将积极参与风险低且可控的债券回

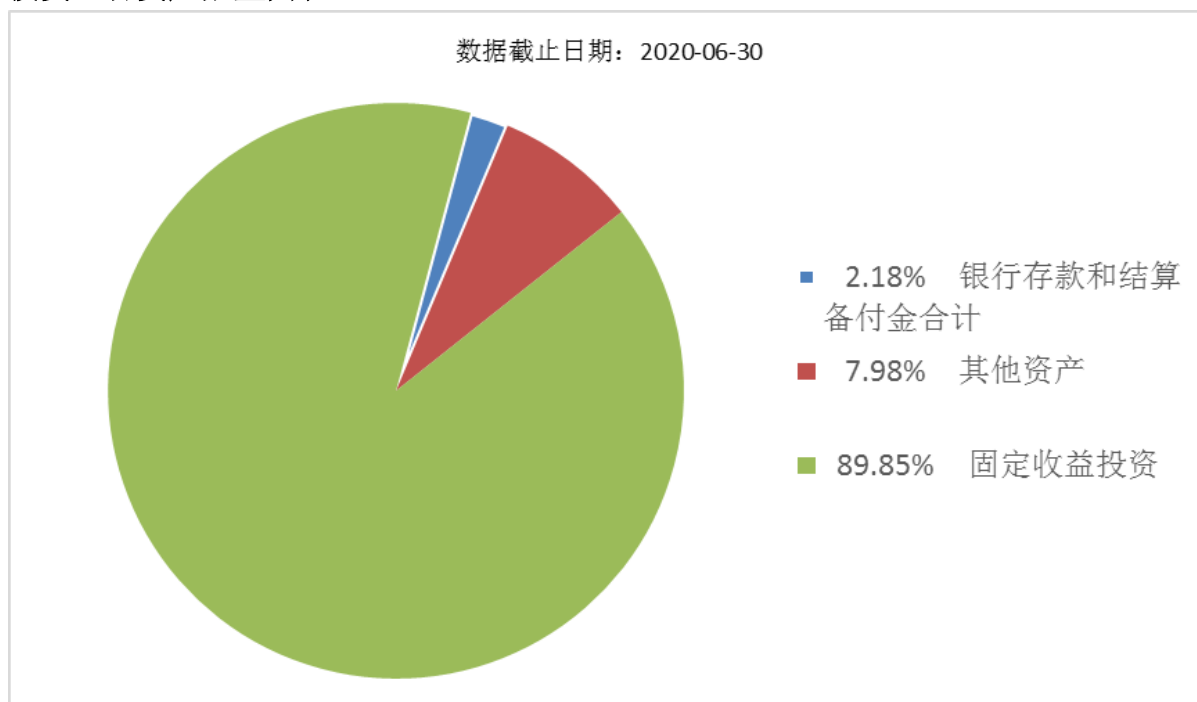
	购等投资，以弥补基金费用、增加基金收益。主要投资策略包括债券指数化投资、中小企业私募债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资等。
业绩比较基准	本基金的标的指数为上证3-5年期中高评级可质押信用债指数，业绩比较基准为标的指数收益率，即上证3-5年期中高评级可质押信用债指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险收益水平相应会高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。 本基金属于指数基金，采用分层抽样复制策略，跟踪上证3-5年期中高评级可质押信用债指数，其风险收益特征与标的指数所表征的债券市场组合的风险收益特征相似。

①投资者请认真阅读《招募说明书》“基金的投资”章节了解详细情况。

②根据 2017 年施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和销售机构已对本基金重新进行风险评级，基金的风险收益特征不代表基金的风险评级，具体风险评级结果参见基金管理人、销售机构提供的评级结果。

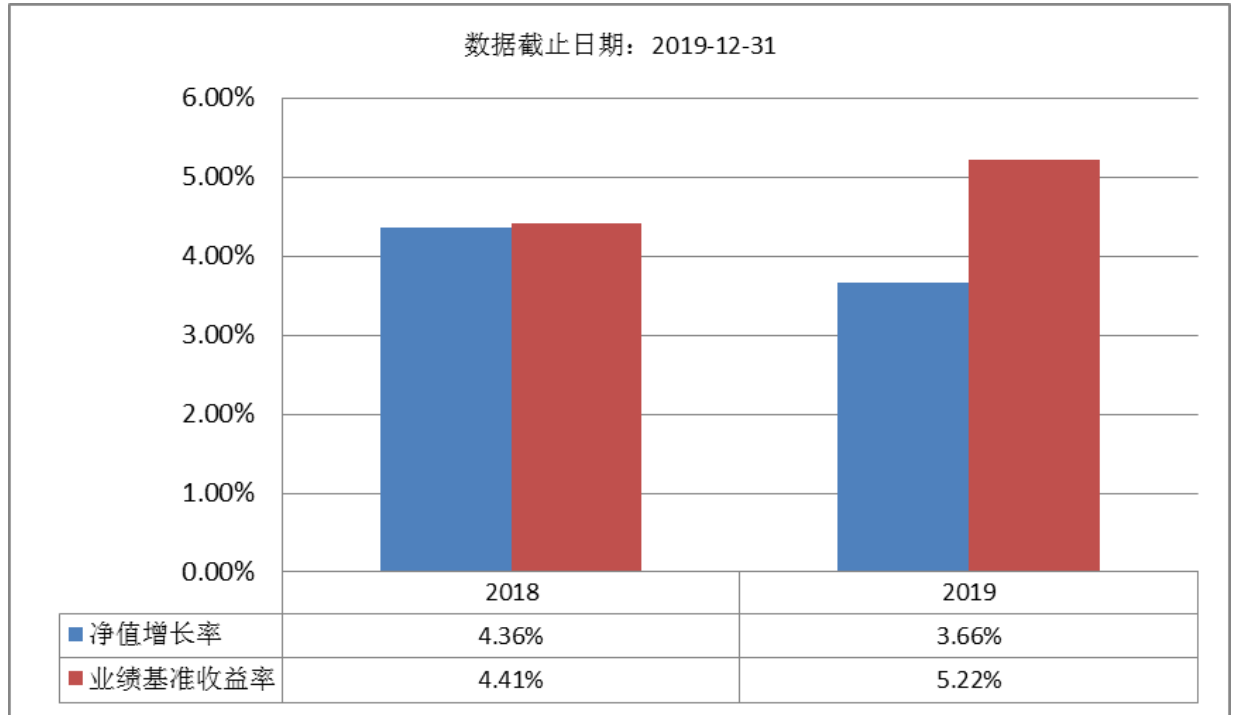
## (二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

### 投资组合资产配置图表



注：图示比例为截至最近一次披露的定期报告期末基金投资组合中各类资产金额占基金总资产的比例。

## (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：①本基金合同于2018年5月3日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

②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

①投资人在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过申购或赎回份额

0.4%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

②场内交易费用以证券公司实际收取为准。

#### （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	固定费率 0.25%
托管费	固定费率 0.08%
其他费用	基金合同生效后与本基金相关的信息披露费、会计师费、律师费、基金份额持有人大会费用等可以在基金财产中列支的其他费用按照国家有关规定和《基金合同》约定在基金财产中列支。费用类别详见本基金基金合同及招募说明书或其更新。

注：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。

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，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险，中小企业私募债券投资风险，衍生品投资风险，信用风险，本基金的其他特定风险等。

本基金作为 ETF，特定风险还包括：标的指数回报与债券市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、申购赎回清单差错风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、退市风险、投资者申购赎回失败的风险、场内基金份额赎回对价的变现风险、基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险等。

虽然本基金指数成分券主要为主体评级在 AA+以上的可质押公司债和企业债，但由于其都属于信用债品种，组合仍然面临个别债券信用评级下调和违约无法支付到期本息的风险，由于组合中相关债券的发行人在指数重新调样之前信用等级降低导致债券价格下降，将造成基金资产损失。

根据基金合同的相关规定，本基金每日可设定申购份额、赎回份额上限，对于超出设定份额上限的申购、赎回申请，基金管理人有权予以拒绝。

## （二）重要提示

中国证监会对本基金募集的注册或核准，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。

基金的过往业绩不代表未来表现。

基金销售相关费用中的认购/申购金额含认购/申购费。

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。

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。

基金投资人请认真阅读基金合同的争议处理相关章节，充分了解本基金争议处理的相关事项。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[[www.ChinaAMC.com](http://www.ChinaAMC.com)][ 400-818-6666]：

- 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