华夏海外收益债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

2019年第1号

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

重要提示

华夏海外收益债券型证券投资基金经中国证监会2012年10月8日证监许可［2012］1323号文核准募集。本基金基金合同于2012年12月7日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，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。

本基金为投资于全球证券市场的债券基金，投资者会因为所投资的国家（产生政治、经济、法律、市场或货币等因素可能带来的特别风险，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：全球市场投资面临的汇率风险、国别风险、新兴市场风险等特殊投资风险；基金所投资的债券，发生违约等各种投资工具的相关风险；由于基金份额持有人连续大额赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的未按投资预期收益率低于投资基金、高于投资市场基金，属于较低风险、较低收益的品种。

本基金风险揭示的内容主要包括：投资市场风险、证券市场波动等因素产生的风险；由于基金份额持有人在连续赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的未按投资预期收益率低于投资基金、高于投资市场基金，属于较低风险、较低收益的品种。

投资有风险，投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身风险承受能力、特性判断市场、谨慎做出投资决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

本摘要根据本基金的合同和招募说明书编写，并按中国证监会核准、基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件，基金投资者自信基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《证券办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2019年6月7日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2019年3月31日。（本招募说明书中的财务资料未经审计）

一、基金的名称

本基金名称：华夏海外收益债券型证券投资基金。

二、基金的类型

本基金类型：契约型开放式。

三、基金的投资目标

在控制风险的前提下，追求长期稳定的回报。

四、基金的投资方向

本基金主要投资于全球证券市场中具有良好流动性的固定收益类金融工具（含以外币计价和以人民币计价）包括政府债券、公司债券、可转换债券、住房抵押证券、资产支持证券、基金可投资于前地产信托证、固定收益类基金、结构性投资产品、金融衍生产品等与债券相关或具有固定收益特征的金融工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金为债券基金，债券类金融工具的投资比例不低于基金资产的80%。

如思析系法律法规或证监会允许基金投资境内市场的，本基金根据届时的相关法律法规，依据推护投资者利益的原则，适度参与境内市场投资。

五、基金的投资策略

（一）国家/地区配置策略

本基金根据对全球市场经济发展的判断，以及对不同国家和地区宏观经济、财政和货币政策、证券市场走势、金融市场环境的分析，确定基金资产在不同国家和地区的配置比例。

（二）债券类属配置策略

本基金根据对经济周期及其变化趋势等特征的研究和判断，根据对政府债券、信用债、可转换等不同债券板块之间的相对投资价值分析，确定不同经济周期阶段下的债券类属配置策略，并根据经济周期阶段变化及时进行调整。从而有效规避经济不同发展阶段的投资机会，实现基金资产的保值增值。

（三）信用债投资策略

本基金将主要通过深入并持有信用风险可承受、期限与收益率相对评估的信用债券产品，获取票息收益。此外，本基金还将通过对内外部评级、利差曲线研究和经济周期的判断，主动采用信用利差投资策略，获取利差收益。

（四）可转换投资策略

本基将在充分研究的基础上，选择基本面良好、具有一定安全边际的可转换进行投资，在严格控制风险的前提下获得稳定收益，本基金将以可转换债券券期权特有的股票需在其可交换之后起的5个月内实出。

（五）久期管理策略

本基金根据对利率水平的预测，在预期利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益，在预期利率上升时，减小组合久期，以规避债券价格下降的风险。

（六）汇率避险策略

密密根据汇率动向，通过对各国/地区的宏观经济形势、货币政策、市场环境以及其他可能影响汇率走势的因素进行深入分析，并结合相关外汇研究机构的结果，判断主要汇率走势，并适度进行外汇远期、期货、期权等汇率衍生品投资，以降低外汇风险。

（七）衍生品投资策略

本基金将以投资组合避险或有效管理为目标，在基金风险承受能力许可的范围内，本着谨慎原则，适度参与衍生品投资，包括远期、期权、期货等，以更好地进行组合风险管理，提高组合运作效率，实现投资目标。

此外，在严格控制风险的前提下，本基金将适度参与证券借贷交易，以期区间等收益率投资，以增加收益。

未来，随着全球证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

六、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：同期人民币一年期定期存款税后利率。

七、基金的风险收益特征

本基金的预期风险收益特征：本基金属于中等风险、较高收益的品种，其长期风险收益特征一般高于货币市场基金、高于债券基金、高于混合基金、低于股票基金。

八、基金投资组合报告

以下内容截止日为本报告期末（2019年第1季度报告）：

6.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
2	基金投资	23,082,287.75	2.29
3	固定收益投资	787,776,142.70	83.25
	其中：债券	787,776,142.70	83.25
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	119,200,341.69	12.60
8	其他各项资产	18,254,289.90	1.93
9	合计	946,313,061.04	100.00

6.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的投资及存在汇兑风险投资分布

本基金在报告期末未持有投资及存在汇兑。

6.3 报告期末按行业分类的股票及存在汇兑风险投资组合

本基金在报告期末未持有投资及存在汇兑。

6.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存在汇兑投资明细

本基金在报告期末未持有投资及存在汇兑。

6.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

债券代码	债券名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	1580223	40,401,000	4,040,040.00	4.27
2	1580186	30,000,000	3,000,000.00	3.17
3	1580174	29,974,713.93	2,997,471.39	3.17
4	1580223	26,934,000	2,693,400.00	2.85
5	1580186	26,927,287.30	2,692,728.73	2.85
6	1580174	24,500,025.66	2,450,002.57	2.59
7	1580223	23,989,329.53	2,398,932.95	2.53
8	1580186	23,082,287.75	2,308,228.78	2.44
9	1580174	22,000,000.00	2,200,000.00	2.33
10	1580223	21,000,000.00	2,100,000.00	2.22

6.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金在报告期末未持有股票及存在汇兑。

6.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金在报告期末未持有贵金属及存在汇兑。

6.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金在报告期末未持有权证。

6.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金在报告期末未持有资产支持证券。

6.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

本基金在报告期末未持有金融衍生品。

6.11 投资组合报告附注

6.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

6.11.2 报告期内投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

6.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	200,53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	91,754.51
4	应收利息	11,107,164.16
5	应收申购款	6,916,169.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,254,289.90

6.11.4 处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	XS1513289006	CN YANKTZE PWR INTL BV11	10,913,724.14	1.20

6.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

6.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。"

九、基金的业绩

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

华夏双债债券（QDII）A：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
2012年12月7日至2012年12月31日	0.20%	0.03%	0.25%	0.00%	-0.05%	0.03%
2013年1月1日至2013年12月31日	5.89%	0.34%	4.25%	0.00%	1.64%	0.34%
2014年1月1日至2014年12月31日	-0.28%	0.26%	4.22%	0.00%	-4.50%	0.26%
2015年1月1日至2015年12月31日	14.13%	0.36%	3.37%	0.00%	10.76%	0.36%
2016年1月1日至2016年12月31日	13.65%	0.25%	2.75%	0.00%	10.90%	0.25%
2017年1月1日至2017年12月31日	3.46%	0.21%	2.75%	0.00%	0.71%	0.21%
2018年1月1日至2018年12月31日	0.97%	0.28%	2.75%	0.00%	-1.78%	0.28%
2019年1月1日至2019年3月31日	3.53%	0.25%	0.68%	0.00%	2.85%	0.25%

华夏双债债券（QDII）E：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
2012年12月7日至2012年12月31日	0.10%	0.02%	0.25%	0.00%	-0.15%	0.02%
2013年1月1日至2013年12月31日	5.49%	0.34%	4.25%	0.00%	1.24%	0.34%
2014年1月1日至2014年12月31日	-0.68%	0.26%	4.22%	0.00%	-4.90%	0.26%
2015年1月1日至2015年12月31日	13.66%	0.36%	3.37%	0.00%	10.29%	0.36%
2016年1月1日至2016年12月31日	13.11%	0.25%	2.75%	0.00%	10.44%	0.25%
2017年1月1日至2017年12月31日	2.93%	0.21%	2.75%	0.00%	0.18%	0.21%
2018年1月1日至2018年12月31日	0.66%	0.28%	2.75%	0.00%	-2.09%	0.28%
2019年1月1日至2019年3月31日	3.38%	0.25%	0.68%	0.00%	2.70%	0.25%

十、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区A区

办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

设立日期：1998年4月9日

法定代表人：杨明辉

联系人：邱曦

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-63136700

华夏基金管理有限公司注册资本为22800万元，公司股权结构如下：

	持股/出资比例	持股占比按本比例
中信证券股份有限公司	62.2%	62.2%
POWER CORPORATION OF CANADA	13.9%	13.9%
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	13.9%	13.9%
天津海鹏科技投资有限公司	10%	10%
合计	100%	100%

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

杨明辉先生：董事长、党委书记、硕士、高级经济师。现任中信证券股份有限公司党委副书记、执行董事、总经理、执行委员会委员、华夏基金（香港）有限公司董事长、管任中信证券公司董事、副董、副总经理、中信控股公司董事、中信证券国际有限公司董事、中国证券投资基金业协会第六届理事会理事、中国建设银行股份有限公司董事长、中国证券投资基金业协会第六届理事会理事、中国证券业协会第六届理事、中国证券业协会第六届理事、中国证券业协会第六届