

华夏海外收益债券型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

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,但中国证监会不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认证,也不表示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,基金净值会因为所投资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:全球市场投资面临的汇率风险、国别风险、新兴市场风险等特别投资风险;基金所投的债券、衍生品等各种投资工具的信用风险;由于基金份额持有人连续大量赎回基金份额的流动性风险,基金管理人在基金投资实施过程中产生的积极管理风险等。本基金是债券基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金,属于较低风险、较低收益的品种。

本基金A类份额同时以人民币和美元销售,美元申购赎回价格按照行业相应基金份额净值以人民币进行最近公布的人民币对美元汇率中间价计算的美元折算净值,由于汇率波动,可能导致以美元计算的收益率和人民币计算的收益率存在差异。

投资有风险,投资者在投资基金前,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,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断投资,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。

本摘要根据基金的基金合同和招募说明书编写,并经中国证监会核准。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,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》、《运作办法》、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。

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

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、住房按揭支持证券、资产支持证券;基金还可投资于房地产信托凭证、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%。

如果将来法律法规或证监会允许基金投资境内市场的,本基金将根据届时的相应法律法规,依据维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

本基金将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、政治和货币政策、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)债券类配置策略

本基金将基于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、可转债等不同债券板块之间的相对投资价值分析,确定不同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。从而有效把握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)信用债券投资策略

本基金将主要通过买入并持有以信用风险为导向,期限与收益率相对合理的信用产品,获取票息收益。此外,本基金还将通过对外部评级、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)可转债投资策略

本基金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债进行投资,在严格控制风险的前提下获得稳定收益。本基金因可转债转换等原因为持有的股票需在其可交易之日起的3个月内卖出。

(五)久期管理策略

本基金将根据对利率水平的预期,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涨带来的收益,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

基金管理人将基于对宏观经济、货币环境以及地缘政治等对债券投资的影响,通过深入分析,并结合相关外汇市场的走势、汇率、期限等汇率衍生品,以降低外汇风险。

(七)衍生品投资策略

本基金将根据对衍生品的了解,通过综合运用衍生品,获取收益。此外,在严格控制风险的前提下,本基金将适度参与衍生品交易,从而有效把握衍生品交易的投资机会。

六、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准:同期人民币3年定期存款税后利率。

其中,人民币3年定期存款利率是指中国人民银行公布的金融机构三年期人民币基准利率,其中基金投资范围,或人民币银行存款基准利率,或人民币其他更符合基金基准的,本基金管理人可根据具体情况,依据维护基金份额持有人合法权益的原则,取得基金托管人同意后,对业绩比较基准进行相应调整。

七、基金的风险收益特征

本基金为债券基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金,混合基金,高于货币市场基金。属于较低风险、较低收益的品种。同时,本基金为境外证券投资基金,除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险之外,本基金还面临汇率风险、国别风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。

八、基金投资组合报告

以下内容摘自本基金2015年第3季度报告:

“5.1 报告期末本基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产的比例(%)
1	债券投资	15,796,490.02	95.07
其中:国债			
2	基金投资	4,030,060.00	2.99
3	股票投资	144,442,261.02	9.02
其中:债券			
4	金融衍生品投资	-	-
其中:远期			
5	买入返售金融资产	-	-
其中:质押式回购			
6	银行存款	10,740,150.03	6.67
7	其他各项资产	6,772,877.77	3.40
9	合计	165,895,360.00	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资:

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.4 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托凭证明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	占基金资产的比例(%)
1	HED0000147014	FUTURE LAND DEVELOPMENT	12,000,000	11,966,160.00	7.20
2	X3124630333	WEICHAI INT'L HK ENERGY	9,541,950	9,474,011.32	5.75%
3	X3120750037	BANK OF COMMUNICATIONS	7,633,560	7,521,117.06	4.57%
4	X3100444391	CPT HOLDINGS GROUP	7,633,560	7,197,895.40	4.37%
5	150890146487	MAOTY INTERNATIONAL HOLD	6,717,533	6,521,912.84	3.96%

注:本债券投资组合主要采用标准普尔、穆迪等机构提供的债券信用评级信息,未提供评级信息的可适用内部评级。

5.6 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.8 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衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有衍生品投资。

5.9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金投资。

5.10 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债权投资

本基金本报告期末未持有债权投资。

5.11 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托凭证

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.12 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债券投资

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.13 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基金投资

本基金本报告期末未持有基金投资。

5.14 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衍生品投资

本基金本报告期末未持有衍生品投资。

5.15 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.16 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及存托凭证

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.17 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基金投资

本基金本报告期末未持有基金投资。

5.18 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债权投资

本基金本报告期末未持有债权投资。

5.19 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托凭证

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.20 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债券投资

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.21 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基金投资

本基金本报告期末未持有基金投资。

5.22 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衍生品投资

本基金本报告期末未持有衍生品投资。

5.23 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.24 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及存托凭证

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.25 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基金投资

本基金本报告期末未持有基金投资。

5.26 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债权投资

本基金本报告期末未持有债权投资。

5.27 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托凭证

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.28 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债券投资

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.29 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基金投资

本基金本报告期末未持有基金投资。

5.30 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衍生品投资

本基金本报告期末未持有衍生品投资。

5.31 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.32 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及存托凭证

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.33 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基金投资

本基金本报告期末未持有基金投资。

5.34 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债权投资

本基金本报告期末未持有债权投资。