

重要事項：

香港交易及結算所有限公司（「香港交易所」）、香港聯合交易所有限公司（「聯交所」）、香港中央結算有限公司（「香港結算」）及證券及期貨事務監察委員會（「證監會」）對本公告的內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並表明不會就本公告全部或任何部分內容而產生或因依賴該等內容而引致的任何損失承擔任何責任。

證監會認可不代表證監會對本計劃作出推薦或認許，亦不代表其對本計劃的商業利弊或其表現作出保證。這不表示本計劃適合所有投資者或認許本計劃適合任何特定投資者或類別投資者。

此乃重要文件，務需閣下即時垂注。閣下如對本公告的內容有任何疑問，閣下應尋求專業意見。投資涉及風險，由於概不保證投資回報，故可能導致重大虧損。

基金經理就本公告所載資料之準確性承擔全部責任，並在作出一切合理查詢後確認已盡其所知所信，並無遺漏其他事實，以致其中任何陳述具有誤導成分。



CSOP ETF 系列（「信託」）

（根據香港《證券及期貨條例》（香港法例第571章）第104條
獲認可的香港傘子單位信託）

南方富時中國 A50 ETF

股份代號：82822（人民幣櫃台）及 02822（港幣櫃台）

南方東英中國創業板指數 ETF

股份代號：83147（人民幣櫃台）及 03147（港幣櫃台）

南方東英 MSCI 中國 A 股國際通指數 ETF

股份代號：83149（人民幣櫃台）及 03149（港幣櫃台）

工銀南方東英標普中國新經濟行業ETF

股份代號：03167（港幣櫃台）、83167（人民幣櫃台）及 9167（美元櫃台）

公告

更改證券借貸交易政策

南方東英資產管理有限公司作為信託的基金經理（「基金經理」）謹此通知南方東英中國創業板指數 ETF（「子基金」）的單位持有人在投資目標及策略中加入證券借貸交易，及南方富時中國 A50 ETF、南方東英 MSCI 中國 A 股國際通指數 ETF 與工銀南方東英標普中國新經濟行業 ETF（合稱「各子基金」）的單位持有人各子基金的證券借貸交易政策之變更，於 2019 年 11 月 25 日（「生效日期」）起生效。

本公告中所引用的專有用詞（另有界定者除外）具有信託章程所賦予該等詞彙之涵義。

在子基金投資目標及策略中增加證券借貸交易

為加強有效的投資組合管理，基金經理決定在子基金的投資目標及策略中增加證券借貸交易，具體如下（自生效日期起生效）：

基金經理可代表子基金進行最高為子基金資產淨值的**50%**，預期為子基金淨資產值的約**20%**的證券借貸交易。基金經理能隨時收回借出證券。所有證券借貸交易只會在符合子基金最佳利益並且按照有關證券借貸協議的情況下才進行。基金經理可全權酌情隨時終止該等交易。作為證券借貸交易的一部分，子基金必須收取現金及/或非現金抵押品，其價值須為所借出證券價值（包括利息、股息及其他後續權利）的**100%**。抵押品每日按市價估值並由受託人或受託人指定的代理人保管。所收取的非現金抵押品不可出售、再作投資或質押。所收取的現金抵押品的任何再投資須遵守章程第一部分附件一的「抵押品」一節所載之規定。

倘子基金進行證券借貸交易，所有產生的收益（在扣除直接及間接開支，在適用的法律和監管要求允許的範圍內，作為就證券融資交易所提供的服務支付合理及正常補償後）應退還予子基金。與證券借貸交易有關的成本須由借用人承擔。

章程附錄2和子基金的產品資料概要（「產品資料概要」）中的相關風險披露將進行相應更新。

更改各子基金證券借貸交易政策

根據經修訂的《單位信託和互惠基金守則》的第7.32至7.38章（關於證券融資交易），基金經理已決定對各子基金的現有證券借貸交易政策進行如下修訂（自生效日期起生效）：

| <u>現有的證券借貸交易政策</u> | <u>自生效日期起的證券借貸交易政策</u> |
|---|--|
| 基金經理可代表各子基金進行最多達各子基金資產淨值 30% 的證券借貸交易。 | 基金經理可代表各子基金進行最高為各子基金資產淨值的 50% ，預期為各子基金淨資產值的約 20% 的證券借貸交易。 |
| 作為證券借貸交易的一部分，各子基金必須收取現金抵押品，其價值須為所借出證券價值（包括利息、股息及其他後續權利）的 105% 。託管人只會按照訂約方的協定收取現金作為抵押品。抵押品每日按市價估值並由託管人保管。 | 作為證券借貸交易的一部分，各子基金必須收取現金及/或非現金抵押品，其價值須為所借出證券價值（包括利息、股息及其他後續權利）的 100% 。抵押品每日按市價估值並由受託人或受託人指定的代理人保管。 |
| 基金經理不會以收取的抵押品進行任何再投資。 | 所收取的非現金抵押品不可出售、再作投資或質押。所收取的現金抵押品的任何再投資須遵守章程第一部分附件一的「抵押品」一節所載之規定。 |

章程和各子基金的產品資料概要中的相關風險披露將進行相應更新。

綜述

基金經理認為，增加子基金的證券借貸交易以及修訂各子基金的證券借貸交易政策符合子基金和各子基金之最佳利益。本公告所述的變動不會對現有投資者的權益造成重大損害，並且在變更後，子基金和各子基金的整體風險狀況也不會發生任何重大變化或增加。變動不會產生任何成本和/或費用。

經修訂的章程

上述變更和相應修訂將以經修訂的信託章程（通過附錄的形式）以及子基金和各子基金的产品資料概要反映，並將自生效日期起被發表在基金經理的網站（www.csopasset.com）和香港交易所網站（www.hkexnews.hk）。

進一步資料

閣下如對本公告的任何事宜有任何疑問或需要進一步資料，請於香港中環康樂廣場 8 號交易廣場二期 2801-2803 室聯絡基金經理或致電客戶服務熱線：(852) 3406 5688。

承董事會命
南方東英資產管理有限公司
行政總裁
丁晨

2019 年 10 月 25 日

截至本公告日期，基金經理的董事會由七名董事組成，分別是周易先生、丁晨女士、張高波先生、楊小松先生、蔡忠評先生、柳志偉先生及劉秀焰女士。