

**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 系列三

（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）

**南方東英恒生指數 ETF**  
上市類別股份代號：**03037**（港幣櫃台）

## 公告 指數編算方法變更

南方東英資產管理有限公司 CSOP Asset Management Limited（「**基金經理**」）謹此通知南方東英恒生指數 ETF（「**子基金**」）的單位持有人，恒生指數有限公司（「**指數提供者**」）將從 2023 年 11 月份之指數檢討開始實施對子基金的相關指數恒生指數（「**恒指**」）的更改，並將於 2023 年 12 月份之指數調整中（亦即在 2023 年 12 月 4 日「**生效日期**」）生效。

投資者在買賣子基金的單位時應小心行事。除非另有釋義，否則所有術語應與子基金章程內的含義相同。

## **指數編算方法變更**

基金經理謹此通知子基金的單位持有人，指數提供者將從 2023 年 11 月之指數檢討開始更新恒指的指數編算方法，檢討結果預計將於 2023 年 11 月 17 日（「**實施日期**」）公佈，並將於 2023 年 12 月份之指數調整中生效。需特別注意將進行以下變更：

### (1) 將主要上市的外國公司納入恒指選股範疇

恒生綜合大中型股指數中的主要上市外國公司將符合恒指成份股的候選資格。外國公司個別成份股於恒指中的比重上限設定為 4%。外國公司成份股於恒指中合計比重上限設定則為 10%。「外國公司」是指 (i) 在香港以外註冊成立的公司；(ii) 非中國內地公司（即非 H 股、紅籌股及民企股公司）；(iii) 歷史、總部、管理層及/或主要營業地點位於香港、澳門、中國內地或台灣以外的公司。

### (2) 於恒指中取消「香港」成份股數目上限

目前恒指中「香港」成份股數目固定為 20 至 25 隻。自實施日期起，「香港」成份股數目上限（即 25 隻）將會取消，並只保留「香港」成份股數目下限（即 20 隻）。「香港」成份股指非中國內地及非外國公司。

詳情（包括指數編算方法、最新指數資料及其他重要資訊），請參閱指數提供者的網站 [www.hsi.com.hk](http://www.hsi.com.hk)（此網站未經證監會審閱）。

## **對子基金的影響**

本公告所述之變更不會對現有投資者的權益造成重大損害。變更後子基金的整體風險狀況也不會發生任何重大變更或增加。該變更將不會影響相關指數在證監會的單位信託及互惠基金守則項下要求的獲接納準則。本公告所述之變更不會影響子基金的運作和投資策略及/或管理子基金的方式。變更不會產生任何成本及/或費用。

## **一般事項**

上述變更及相應的修訂將反映於子基金經修訂的章程及產品資料概要，並將於生效日期或前後於基金經理的網站([www.csopasset.com](http://www.csopasset.com))（此網站未經證監會審閱）及香港交易所的網站 ([www.hkexnews.hk](http://www.hkexnews.hk)) 公佈。

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

2023年11月15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、柳志偉先生及朱運東先生