

- 本產品乃被動式交易所買賣基金。
- 本概要向閣下提供有關本產品的重要資料。
- 本概要是章程的一部分。
- 閣下不應單憑本概要投資本產品。

#### 資料便覽

股份代號:	3037
每手交易數量:	500 個單位
基金經理:	南方東英資產管理有限公司
受託人及過戶處:	中銀國際英國保誠信託有限公司

相關指數:	恒生指數
基本貨幣:	港元 (「港元」)
交易貨幣:	港元
本基金的財政年度終結日:	12 月 31 日
派息政策:	基金經理經考慮子基金已扣除費用及成本的收入淨額後全權酌情向單位持有人分派收入。目前基金經理擬經考慮每年 (於五月及十一月) 向單位持有人分派兩次收入。基金經理可按其酌情權從資本中撥付股息或實際上從資本中撥付股息。

全年經常性開支比率\*: 0.10%

上一曆年的跟蹤偏離度\*: -0.05%

子基金網址<sup>^</sup>: <http://www.csopasset.com/tc/products/hk-hsi>

#經常性開支比率是根據截至 2023 年 12 月 31 日的年度費用計算。每年均可能有所變動。子基金的經常性開支數字上限為每年 0.1% (「經常性開支上限」)。任何超出子基金經常性開支上限的經常性開支將由基金經理承擔, 不會計算入子基金內。

+該數據為上一曆年的實際跟蹤偏離度。投資者應查詢子基金網站以獲得更加更新的實際跟蹤偏離度的信息。<sup>^</sup> 該網站未經證監會審查。

#### 這是甚麼產品?

南方東英恒生指數 ETF (「子基金」) 是 CSOP ETF 系列三 (「本信託」) 的一個子基金, 而本信託是根據香港法例成立的傘子單位信託。子基金乃根據《單位信託及互惠基金守則》(「守則」) 第 8.6 章認可的被動式管理指數追蹤基金。子基金的上市類別單位猶如上市股票份額一樣在香港聯合交易所有限公司 (「聯交所」) 買賣。

子基金提供上市類別單位 (「上市類別單位」) 及非上市類別單位 (「非上市類別單位」)。本概要載有關於發售上市類別單位的資料, 而除另有指明外, 本概要凡提及「單位」均指「上市類別單位」。有關非上市類別單位的資料, 投資者應參閱另一份概要。

#### 目標及投資策略

##### 目標

子基金的投資目標是提供緊貼恒生指數 (「相關指數」) 表現的投資成績 (扣除費用及開支前)。概不保證子基金將會達致其投資目標。

## **投資策略**

為了達致子基金的投資目標，子基金將採取全面複製策略，按組成相關指數的證券（「**指數證券**」）在相關指數內大致的相同比重，將子基金的所有或絕大部分資產直接投資於此等指數證券。

在特殊情況下（即由於限制，暫停交易，某些指數證券的有限可用性，公司重大事件，或者由基金經理認為存在重大的市場定價錯誤或可預見的市場動蕩），若由於限制或有限可用性而獲得相關指數成分的某些證券不可行或不符合投資者最佳利益時，和／或通過參考子基金的資產淨值，使用完全複製策略無法實現成本效益，基金經理或使用代表性的抽樣策略投資於：

- (i) 表現與相關指數密切相關的具代表性樣本，惟成分可能或可能不是相關指數的組成部分；及／或
- (ii) 其他集體投資計劃（CIS）。「CIS」是指交易所買賣基金及／或非上市指數跟踪基金，追蹤與相關指數高度相關的指數。子基金投資其他 CIS 的上限不得超過子基金資產淨值的 10%，且子基金不得持有超過任何一個 CIS 發行單位的 10%；及／或
- (iii) 若基金經理認為此類投資將有助於子基金實現其投資目標，並有利於子基金，基金經理可以投資和對沖為目的將不超過子基金資產淨值的 10% 投資於金融衍生工具（「**金融衍生工具**」）（主要是與一個或多個交易對手進行掉期交易）

若非由於相關指數平衡或相關指數相關而在投資組合中持有相關指數的任何非成分股，為提高透明度，基金經理將立即在其網站上披露這些非組成證券和其他 CIS 的名稱和購買權重，並於賣出之前每日報告。

基金經理並無意代表子基金為任何目的而參與證券借貸、銷售及回購交易及逆回購交易。

除上文披露於特殊情況下採取全面複製策略外，基金經理不擬就對沖目的而投資於金融衍生工具。

## **相關指數**

相關指數是一項經調整自由流通量市值加權指數，相關指數旨在作為反映香港股票市場整體表現的市場基準。相關指數的範圍包括指數檢討數據截止日的恒生綜合大中型股指數成份股。不包括第二上市外國公司、合訂證券、股票名稱以「B」結尾的生物科技公司及股票名稱以「PC」結尾的特專科技公司。個別非外國公司成份股的比重上限為 8%，個別外國公司成份股的比重上限為 4%，合計外國公司成份股的比重上限為 10%。

相關指數屬淨總回報指數，即相關指數成份股的表現乃按照任何股息或分派經扣除預扣稅（如有）後再投資而計算得來。相關指數以港元計值及報價。

相關指數由恒生指數有限公司（「**恒生指數公司**」或（「**指數提供者**」）編製及管理，恒生指數公司是恒生銀行有限公司的全資附屬公司。基金經理及其關連人士獨立於恒生指數公司。

相關指數於 2009 年 2 月 25 日推出，於 2008 年 8 月 1 日的基準水平設為 44,276.04。於 2024 年 3 月 22 日，相關指數擁有總市值 198,129.1 億港元及 82 隻成份股。

相關指數成份股及其各自的權重以及相關指數的其他信息載於恒生指數公司網站：

<https://www.hsi.com.hk/eng/indexes/all-indexes/hsi>.

彭博指數代碼：HSINH

## **運用衍生工具 / 投資衍生工具**

基金的衍生工具風險承擔淨額可最多達基金資產淨值的 50%。

## 有甚麼主要風險？

投資涉及風險。請參閱章程以了解風險因素等詳情。

### 1. 投資風險

- 子基金並不保證本金獲得償付，而閣下的投資或會蒙受損失。概不保證子基金將達致各自的投資目標。
- 子基金以被動方式管理，而由於子基金的固有投資性質，基金經理基金經理並無酌情權針對市場變化作出應變。相關指數的價值下跌或會導致子基金的價值隨之下跌。

### 2. 股市風險

- 子基金對股票證券的投資涉及一般的市場風險，其價值可能會因各種因素而波動，例如投資情緒的變化、政治和經濟狀況以及特定的發行人因素。

### 3. 集中風險

- 相關指數追蹤於大中華區註冊成立，或大部分收入來自大中華區，或主要營業地點在大中華區的公司，特別是特定行業的香港上市證券的表現。相較於那些基礎更為廣泛的基金（例如全球性或區域性基金）而言，子基金的資產淨值可能面對更高的波動性，因為相關指數更易受到該單一地區不利情況所帶來的價值波動所影響。

### 4. 依賴市場莊家的風險

- 然基金經理致最大努力實施安排使保最少會有一名市場莊家為單位維持市場，及最少一名市場莊家會根據相關市場莊家安排終止市場莊家安排前給予不少於 3 個月的通知，但如並無市場莊家或只有一名市場莊家，單位的市場流動性或會受到不利影響。亦概不保證任何市場莊家活動將屬有效。

### 5. 買賣風險

- 一般而言，零售投資者只可在聯交所購買或出售子基金單位。單位在聯交所的成交價由市場因素(如單位的需求及供應)帶動，基金單位的交易價格將可能較每基金單位資產淨值大幅溢價或折讓。
- 買賣單位或會涉及適用於所有證券交易的不同種類費用，例如交易費用及經紀佣金。二級市場投資者亦將招致買賣差價的成本，即投資者願意就單位支付的價格（買入價）與投資者願意出售單位收取的價格（賣出價）之間的差額。因此，投資者於聯交所買入單位時，付出的價格可能高於每單位的資產淨值，而於聯交所賣出單位時，得到的收益可能低於每單位的資產淨值。

### 6. 上市及非上市類別單位交易安排不同的風險

- 上市及非上市類別的投資者受不同的定價及交易安排規限。由於適用於各類別的費用及成本不同，上市及非上市類別各自的每單位資產淨值可能不同。上市及非上市類別單位的截止交易時間亦有所不同，並受適用的估值時間規限。
- 上市類別單位按即日現行市價（可能偏離相應的資產淨值）在證券交易所買賣，而非上市類別單位則透過中介人按交易日日終資產淨值出售，並於單一估值時間交易而不會有公開市場交易的日間流動性。視乎市況，上市類別的投資者可能因此較非上市類別的投資者有利或不利。
- 在市場受壓的情況，非上市類別投資者可按資產淨值贖回其單位，而上市類別投資者則不可以，彼等可能須按較大折讓的價格退出子基金。另一方面，上市類別投資者可於日間在二級市場賣出其單位，從而鎖定其狀況，非上市類別投資者則不可以及時這樣做，而須待日終才可鎖定其狀況。

### 7. 跟蹤誤差風險

- 子基金或會涉及跟蹤誤差風險，即其表現未必能準確追蹤相關指數的風險。此跟蹤誤差可能由於所使用的投資策略和費用及開支所導致。基金經理將監控並尋求管理此類風險，以盡量減少跟蹤誤差。概不能保證於任何時候均可確切地或完全複製相關指數的表現。

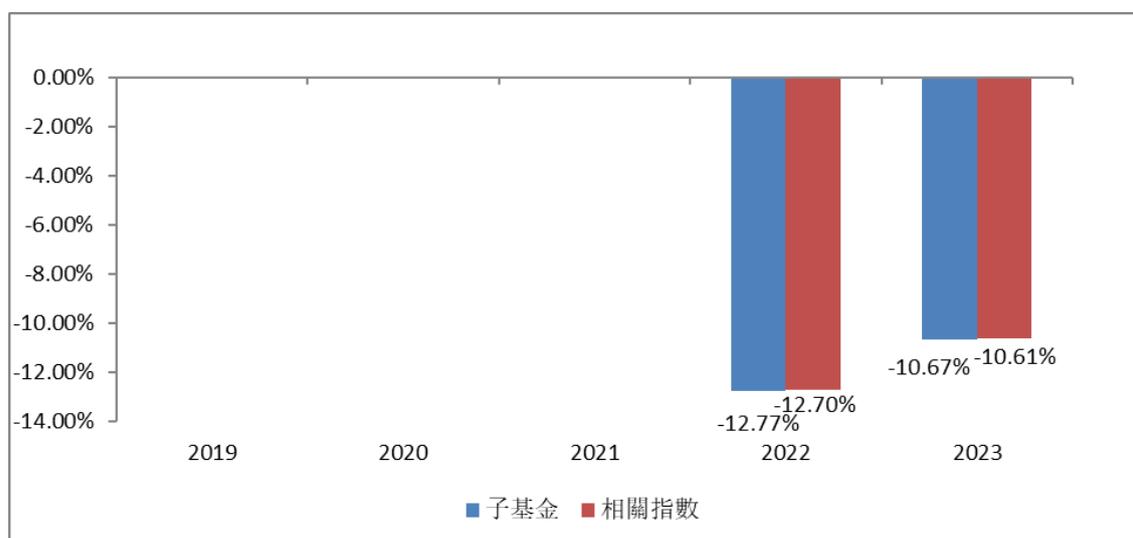
### 8. 提早終止風險

- 倘相關指數被中斷或因其他原因不再可用於制定基準，及 / 或指數授權協議被終止而基金經理未能物色或協定任何指數提供者條款，以使用合適替代指數，或子基金資產淨值降至至低於一千萬美元（或其等值港元），子基金或會在若干情況下終止。若子基金提早終止，投資者或會蒙受損失。子基金終止時，投資者未必能取回其投資，而且可能會蒙受損失。

### 9. 有關從資本中支付分派的風險

- 基金經理可酌情從資本中支付股息或實際上從資本中支付股息。從資本中支付股息或實際上從資本金額中支付股息相當於退還或提取投資者部分原有投資額或歸屬於該原有投資額的資本收益，並可能導致每基金單位資產淨值即時減少。

### 本基金過往的業績表現如何？



- 往績並非預測日後業績表現的指標。投資者未必能取回全部投資本金。
- 基金業績表現以歷年末的資產淨值作為比較基礎，股息會滾存再作投資。
- 上述數據顯示子基金總值在有關年內的升跌幅度。業績表現以港元計算，當中反映出基金的持續費用，但不包括於聯交所交易的費用。
- 如年內沒有顯示有關的業績表現，即代表當年沒有足夠數據用作提供業績表現之用。
- 基金發行日: 2021年5月6日

### 有否提供保證？

子基金並不提供任何保證。閣下未必能取回閣下的投資款項。

### 有甚麼費用及收費？

#### 在聯交所買賣單位所招致的收費

費用	閣下所付金額
經紀費用	按市場費率 <sup>1</sup>
交易徵費	0.0027% <sup>2</sup>
會計及財務匯報局交易徵費	0.00015% <sup>3</sup>
交易費用	0.00565% <sup>4</sup>
印花稅	無

### 子基金就單位應持續支付的費用

<sup>1</sup> 經紀費用應由買方及賣方所用的中介人決定的貨幣支付。

<sup>2</sup> 交易徵費為單位成交價的 0.0027%，應由每名買方及賣方支付。

<sup>3</sup> 會計及財務匯報局交易徵費為單位成交價的 0.00015%，應由每名買方及賣方支付。

<sup>4</sup> 交易費用為單位成交價的 0.00565%，應由每名買方及賣方支付。

以下開支將從子基金中支付。由於支付此等開支會減低子基金相關單位的資產淨值，並可能影響子基金的成交價，因而對閣下造成影響。

	年率（佔單位資產淨值的百分比）
管理費*	每年 0.1%
受託人費用	包括在管理費內
過戶處費用	包括在管理費內
託管人費用	包括在管理費內
表現費	無
行政費	無
其他持續支付的費用	有關子基金應持續支付的費用詳情，請參閱章程第二部分。

\* 務請注意，部分費用可藉向單位持有人發給一個月的事先通知而增加至允許上限的金額。請參閱章程第一部分「費用及收費」一節，以了解應付的費用及收費及該等費用的允許上限，以及子基金可能承擔的其他持續支付費用的進一步詳情。

## 其他資料

基金經理將會在 <http://www.csopasset.com/tc/products/hk-hsi>（該網站未經證監會審查）同時以中、英文發佈有關子基金（包括有關相關指數）的重要消息及資料，包括：

- 章程（經不時修訂及補充）；
- 最新的產品資料概要；
- 最新的年度及半年度財務報告（英文版）；
- 子基金作出的任何公告，包括子基金及相關指數的資料、暫停計算資產淨值、更改費用和收費、暫停及恢復單位發行、增設及贖回的通知；
- 有關子基金或會影響其投資者的重大變動，例如對子基金的銷售文件及組成文件之重大修改或增補的通知；
- 子基金在聯交所正常交易時間內接近實時的指示性每單位資產淨值（每 15 秒更新一次）；
- 子基金的最新資產淨值及子基金的最新每單位資產淨值（以港幣計價）；
- 子基金的完整投資組合（每日更新）；
- 參與交易商及市場莊家的最新名單；
- 最近 12 個月的股息組成（即從可分派收入淨額及資本中支付的相對金額）（亦可向基金經理索取）；
- 子基金的跟蹤誤差及偏離度；及
- 向香港投資者發售的其他類別的過往業績表現資料。

有關上市類別單位：

- 增設申請或贖回申請於就每個交易日而言的交易期間由每個交易日上午 9 時正（香港時間）開始至每個交易日下午 3 時 30 分（香港時間）（以現金申請）或聯交所正式收市後 15 分鐘（香港時間）（以實物申請）的截止交易時間結束，並可由基金經理不時修改\*；及
- 二級市場投資者可於聯交所開市的任何時間，透過其證券經紀在聯交所買賣上市類別單位。投資者可按市價買入或出售上市類別單位。

估值時間約為適用的估值日（即每個交易日）下午 4 時 10 分（香港時間）。

\* 投資者應注意在相關交易日（T 日）交易時間內，即由交易日（T 日）上午 9 時正（香港時間）開始至下午 3 時 30 分（香港時間）（以現金申請），或聯交所正式收市後 15 分鐘（香港時間）（以實物申請），收到的對上市類別單位的增設與贖回申請，將按照於 T 日的估值時間決定的上市類別單位的單位資產淨值處理。例如：

- 於 T 日下午 3 時 30 分（香港時間）（以現金申請），或聯交所正式收市後 15 分鐘（香港時間）（以實物申請）前收到的對上市類別單位的增設與贖回申請，將按照於 T 日的估值時間決定的上市類別單位的單位資產淨值處理；
- 於 T 日下午 6 時（香港時間）收到的對上市類別單位的增設與贖回申請（即於該類別 T 日 截止交易時間，T 日下午 3 時 30 分（香港時間）（以現金申請），或聯交所正式收市後 15 分鐘（香港時間）（以實物申請）），將按照於下一個交易日（T+1 日）的估值時間決定的上市類別單位的單位資產淨值處理。

### 重要提示

- 閣下如有疑問，應諮詢專業意見。
- 證監會對本概要的內容並不承擔任何責任，對其準確性或完整性亦不作出任何陳述。