

**重要事項：**

投資者須注意，所有投資均涉及風險（包括可能會損失投資本金），基金股份價格可升亦可跌，過往表現並不可作為日後表現的指引。投資者在作出任何投資決定前，應詳細閱讀有關本公司之章程（包括子基金的產品資料概要及當中所載之風險因素之全文）。

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」）對本文件之內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並明確表示不會就本文件全部或任何部分內容所產生或因依賴該等內容而引起的任何損失承擔任何責任。

證監會認可不等如對子基金作出推介或認許，亦不是對子基金的商業利弊或表現作出保證，更不代表子基金適合所有投資者，或認許子基金適合任何個別投資者或任何類別的投資者。

此乃重要文件，務請閣下即時垂注。閣下如對本文件之內容有任何疑問，應尋求獨立及專業的財務意見。



**南方東英交易所買賣基金系列開放式基金型公司**  
(「本公司」)

(根據香港《證券及期貨條例》(第 571 章) (「《證券及期貨條例》」) 第 104 條獲認可，具有可變動股本、有限責任且子基金之間的法律責任分隔的香港公眾傘子開放式基金型公司)

**南方東英恒生生物科技 ETF**  
股份代號：3174

**公告**  
**指數計算方法變更**

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生物科技ETF (「子基金」) 的股東，恒生指數有限公司 (「指數提供者」) 將自 2026 年 3 月 9 日 (「生效日期」) 起實施對子基金的指數恒生生物科技指數 (「指數」) 的計算方法變更。

投資者在買賣子基金的股份時應小心行事。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。

## **指數計算方法變更**

基金經理謹此通知子基金的股東，指數計算方法將自生效日期起，加入對股票名稱以「B」結尾的非成份股生物科技公司進行的波動率篩選（詳見下文說明）。

*波動率篩選：*

合資格非成份股的 12 個月歷史波動率<sup>#</sup>（數據截止日前 12 個月的日對數收益率標準差）不應高於指數的 12 個月歷史波動率的 3 倍。

<sup>#</sup> 對於上市時間不足 1 個月的證券，將採用其上市日至數據截止日下一個月最後一個交易日的歷史波動率，與指數在數據截止日前 12 個月的歷史波動率比較。

此調整將於截至 2025 年 12 月 31 日之指數檢討中採用，而相關的變動將於生效日期生效。指數的名稱及指數代碼將維持不變。

詳情（包括指數計算方法、最新指數資料及其他重要資訊），請參閱指數提供者的網站 <https://www.hsi.com.hk/chi/indexes/all-indexes/hsbio>（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，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

2026年2月4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、陳莉女士、楊小松先生、蔡忠評先生、丁晨女士、汪欽先生及張華晨先生。