

產品資料概要

博時中國創業板指數每日槓桿 (2x) 產品
博時槓桿及反向系列旗下產品

2024 年 5 月

發行者：博時基金（國際）有限公司

- 這是一個槓桿產品，與傳統的交易所買賣基金不同，因為這產品尋求相對於指數而且只限於每日的槓桿投資業績。
 - 此產品並非為持有超過一日而設，因為此產品超過一日期間的表現可能偏離於指數在同一期間的槓桿表現而且可能並不相關。
 - 此產品是為進行短期買賣或對沖而設計的，不宜作長期投資。
 - 此產品的目標投資者只限於成熟掌握投資及以買賣為主、明白尋求每日槓桿業績的潛在後果及有關風險並且每日經常監控其持倉表現的投資者。
- 本產品是於交易所買賣的產品。
 - 本概要提供本產品的重要資料。
 - 本概要是章程的一部分。
 - 請勿單憑本概要作投資決定。

資料便覽

股票代號：	7234.HK
每手買賣單位數目：	100 個單位
基金經理：	博時基金（國際）有限公司
受託人：	花旗信託有限公司
登記處：	香港中央證券登記有限公司
全年經常性開支比率 [#] （年度平均每日經常性開支*）：	2.63% (0.0072%)
預計年度平均每日跟蹤偏離度 ^{##} ：	-0.01%
相關指數：	創業板指數(港幣)(CNH)（「指數」）
交易貨幣：	港元（「港元」）
基礎貨幣：	港元（「港元」）
分派政策：	基金經理可根據產品扣除費用及成本後的淨收入，酌情決定向單位持有人每年（十二月）支付分派。基金經理亦可酌情決定

[#] 經常性開支比率代表了 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日期間以產品的資產淨值的百分率表示的產品總經常性開支。此數值每年可能有所變動。此數值並不包括掉期費用。自 2023 年 5 月 15 日起，產品的經常性開支比率數值將以產品的平均資產淨值的 3% 為上限。如產品的費用將導致經常性開支比率數值超過 3%，經理人將承擔任何產品超額的經常性費用並將不計算入產品內。

* 年度平均每日經常性開支數字等於期間經常性開支比率除以該期間的交易日數目。此數值每年可能有所變動。

^{##} 此為預計年度平均每日跟蹤偏離度。有關實際每日跟蹤偏離度及實際平均每日跟蹤偏離度資料，投資者應參閱產品的網站。

以資本或以總收入（所有或部分的費用及支出計入資本）支付分派，以致可供產品支付分派的可分派收入有所增加，因此，產品可能實際上以資本支付分派。所有單位收取之分派的貨幣單位僅為港元（HKD）。

本基金財政年度終結日：

12月31日

ETF 網址：

<http://www.bosera.com.hk/hk/products/funddetail/LI/overview?fundCode=ChiNextLI>

本產品是甚麼？

博時中國創業板指數每日槓桿 (2x) 產品（「產品」）為博時槓桿及反向系列旗下產品，其根據香港法律成立的傘子單位信託。產品的單位（「單位」）如上市股票一般以港元於香港聯合交易所有限公司（「聯交所」）買賣。這是以掉期為基礎的產品，其投資目標是提供在扣除費用及支出之前盡量貼近指數每日表現兩倍（2x）的每日投資業績。產品以港幣計價，限以港幣增設及贖回。

目標及投資策略

目標

產品的投資目標是提供在扣除費用及支出之前盡量貼近指數每日表現兩倍（2x）的投資業績。產品不會尋求在超過一日的期間達到其既定的投資目標。

「每日」就指數的槓桿表現或產品的表現而言，指由某特定營業日相關市場收市之時至下一個營業日相關市場收市之時期間的指數槓桿表現或產品表現（以適用者為準）。

策略

基金經理擬採用以掉期為基礎的合成模擬策略，以達致產品的投資目標。根據此策略，產品將訂立多項部分融資掉期（即與多名掉期對手方訂立的場外金融衍生工具），產品將發行單位而取得的部分認購所得款項淨額提供予掉期對手方作為初始保證金（「初始金額」），初始金額將由受託人委任的保管人以獨立賬戶持有，並僅會於產品違約時才轉移予掉期對手方，而掉期對手方將向產品提供基於指數的持倉（扣除交易成本）。

不多於產品資產淨值（「資產淨值」）的 65% 將通過純現金不時用作取得掉期的初始金額。在特殊情況（如掉期對手方在市場極端動盪時增加初始金額要求）下，初始金額要求可能大幅增加。初始金額將轉移予受託人委任的保管人，保管人將於指定賬戶代產品持有該款項，而掉期對手方將於上述轉移後對初始金額（及相關賬戶）擁有抵押權益。並無法定所有權的轉移及初始金額仍然屬於產品，惟將於其加設以掉期對手方為受益人的抵押權益。

不少於資產淨值的 25%（在上文所述初始金額要求提高的特殊情況下，該百分比可按比例減少）按照《單位信託及互惠基金守則》（「《守則》」）規定投資於現金（港元、人民幣或美元）、現金等價物及以港元、人民幣或美元計價的短期（即到期日少於 3 年）投資級別政府債券。現金等價物將包括香港銀行存款及證監會認可的貨幣市場基金。上述證監會認可的貨幣市場基金將由第三方經理或基金經理管理。上述現金、現金等值項目及短期投資級別政府債券收益將用以應付產品的費用及開支，在扣除該等費用及開支後，餘款將分派予單位持有人。

不多於資產淨值的 10% 可根據《守則》的所有適用規定投資於屬合資格計劃（按證監會定義）或證監會認可或非合資格計劃及未獲證監會認可的集體投資計劃。上述投資可透過基金經理作為 RQFII 的身份作出。為免產生疑問，產品在前段所述的證監會認可的貨幣市場基金中的投資不受此限制。產品除掉期外的所有投資將符合《守則》第 7.36 至 7.38 條。

為免產生疑問，即使政府及其他公共證券由同一人發行，但其還款日期、利率、擔保人身份等方面以不同條件發行，也將被視為不同發行類別。

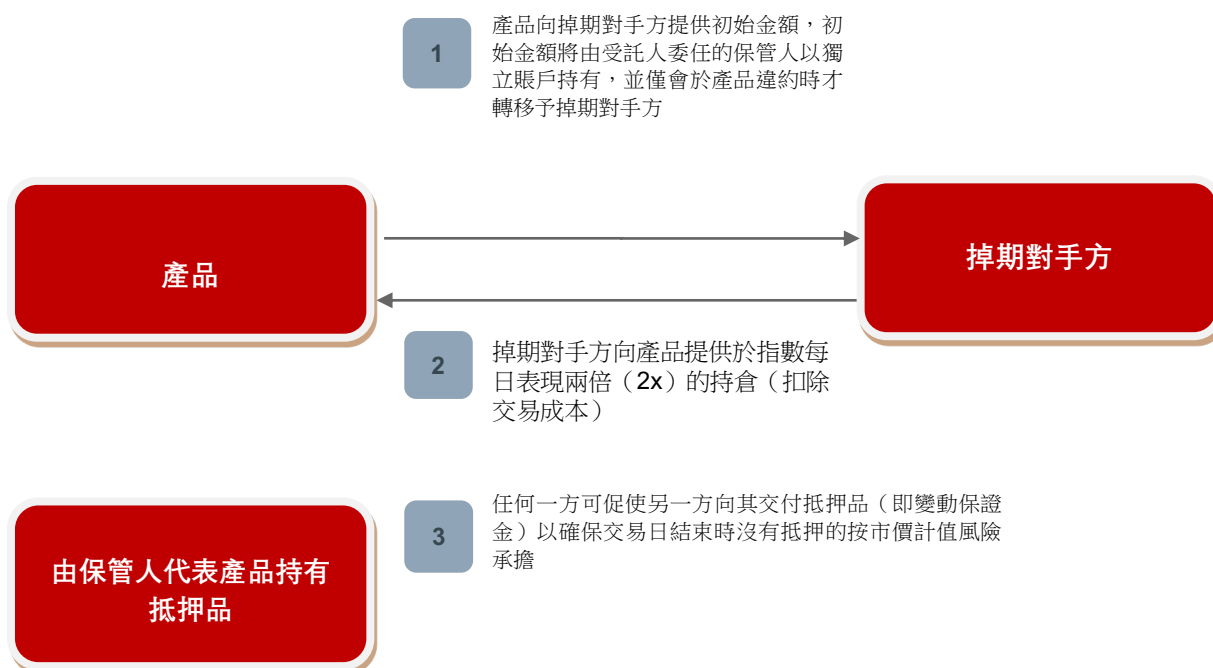
產品將不會進行證券借貸、回購和逆向回購或類似交易。除掉期外，基金經理可以投資於金融衍生工具以作對沖目的，但無意將產品投資於任何金融衍生工具作投資用途。

為就相關掉期下按市價計值的風險獲得抵押，將於掉期交易期間內每個營業日轉移額外金額作為變動保證金（由產品轉移予掉期對手方或反之）。該等變動保證金將以所有權轉讓或以抵押權益（連同就其授予的使用權（類似所有權轉讓））方式轉移。在此過程中，基金經理將管理產品，以確保產品所持抵押品至少相當於產品的對手方風險承擔總額的 100%，並每日按市價計值以維持於該水平，以確保交易日結束時沒有無抵押對手方風險承擔（受即日價格變動、市場風險及結算風險等規限）。倘產品所持抵押品於任何交易日 T 並非至少相當

於產品的對手方風險承擔總額的 100%，則於該交易日 T 結束時，基金經理一般將要求各掉期對手方交付額外抵押資產（即變動保證金）以補足價值差額，該交付預期於交易日 T+1 進行結算。

每個掉期交易對手方將提供抵押品，以期將產品對每個交易對手的風險淨額減少至 0%（零百分比），惟不高於 2,000,000 港元（或等值貨幣）的最低轉讓額將適用。

下圖闡明以掉期為基礎的合成模擬投資策略如何運作：



產品將每日重新調整，於深圳證券交易所及聯交所開放買賣的日子（即營業日）重新調整持倉，將於以下詳細闡述。

每日重新調整

於每個營業日深圳證券交易所收市或接近收市時，產品將尋求重新調整投資組合，就指數的每日收益將增加投資或就指數的每日損失將減少投資，以致產品對指數的每日槓桿投資比率與其投資目標一致。

選擇掉期對手方的準則

選擇掉期對手方（或替代掉期對手方）時，基金經理將考慮多項準則，包括但不限於準掉期對手方或其擔保人為具規模財務機構（按《守則》界定），持續受審慎監督管理；或證監會根據《守則》可接受的其他實體。基金經理亦可設定其認為適當的其他選擇準則。掉期對手方必須獨立於基金經理。

基金經理將在基金經理的網址 www.bosera.com.hk/hk/products/funddetail/LI/overview?fundCode=ChiNextLI（其內容未經證監會審閱）刊發（除其他事項外）產品掉期對手方的身份的最新名單，以及產品對上述每名掉期對手方的風險承擔總額及淨額。

掉期費用

產品將承擔掉期費用，掉期費用由基金經理與掉期對手方根據實際市場情況按每個個案商討及達成共識。現時預計掉期費用介乎產品資產淨值的每年-5.00%至 0.00%。單位持有人須注意這掉期費用僅為最佳估計，實際掉期費用取決於實際市場情況，並可能偏離最佳估計。

基金經理將於產品的年度及半年財務報告中披露掉期費用。掉期費用將由產品承擔，因此可能對資產淨值和產品表現產生不利影響，並可能導致較高的跟蹤誤差。

指數

該指數是一項自由流通市值加權指數，乃為代表在深圳證券交易所（「深交所」）中國創業板上市以總市值、自由流通市值及成交量計排名最高的 100 家 A 股公司的表現而設。產品的指數是中國創業板指數。指數是一項價格回報指數，即表示該指數並不包括從指數證券獲取的股息的再投資。

截至 2023 年 3 月 31 日，該指數覆蓋了約 52.89% 的總市值，並在整個創業板市場具有良好的代表性。

指數是以港幣實時計算和發佈。該指數以港幣計價和報價。

指數於 2021 年 4 月 26 日推出。截至 2023 年 3 月 31 日，其總市值為人民幣 62,289.05 億元。

指數由深圳證券信息有限公司（「深圳證券」或「指數供應商」）編製和管理。基金經理（及其每名關連人士）獨立於指數供應商。

閣下可登錄指數供應商的網站 <http://www.csindex.com.cn/eng/>（此網頁並未經證監會審閱），瀏覽最新的指數成份股名單、其相關權重（下文於指數供應商網站有關「成份股」一節列明）、重要消息以及有關指數的其他資料。

彭博代碼：SZ988006／國證指數代碼：970006

運用衍生工具／投資衍生工具

產品的衍生工具風險承擔淨額可多於產品資產淨值的 100%。

本產品有哪些主要風險？

投資涉及風險。請參閱章程，了解風險因素等資料。

1. 投資風險

- 產品是一項衍生工具產品，並不適合所有投資者。概不能保證一定可付還本金。因此閣下投資於產品或會蒙受巨額或全盤損失。

2. 長期持有風險

- 產品並非為持有超過一日而設，因為產品超過一日期間的表現無論在數額及可能方向上都很可能與指數在同一期間的槓桿表現不同（例如損失可能超出指數跌幅的兩倍）。
- 在指數出現波動時，複合效應對產品的表現有更顯著的影響。在指數波動性更高時，產品的表現偏離於指數槓桿表現的程度將增加，而產品的表現一般會受到不利的影響。
- 基於每日進行重新調整、指數的波動性及隨著時間推移每日回報的複合效應，在指數的表現增強或平穩時，產品甚至可能會隨著時間推移而損失金錢。

3. 合成模擬及對手方風險

- **抵押不足的風險：**基金經理尋求就所有掉期對手方風險承擔取得全面的抵押品保障，以減低對手方風險。存在抵押品的價值可能會大幅低於所抵押金額的風險及因此產品可能蒙受重大損失。任何損失將導致產品的資產淨值減少，並損害產品實現其投資目標的能力。
- **對手方風險及違約風險：**產品尋求向不同掉期對手方訂立一份或多於一份掉期以取得所需持倉。因此，產品承受多名掉期對手方的對手方風險及違約風險，倘任何掉期對手方未能履行其義務，產品可能蒙受重大損失。衍生工具需要承受估值風險和流動性風險，並且容易受到價格波動和較高波動性的影響，可能具有較大的買入和賣出價差而沒有活躍的二級市場。產品可能會承受相等於金融衍生工具全部價值的損失。

日內交易對手方風險：基金經理將管理本產品，以確保本產品持有的抵押品將至少佔本產品總的對手方風險總值的 100%，並保持每日按市價計算，以確保在交易日結束時沒有無抵押的對手方風險敞值。如果該產品持有的抵押品在任何交易日 T 結束時沒有達到該產品在該交易日 T 的總的對手方風險總值

的 100%，基金經理一般會要求每個掉期對手方交付額外的抵押資產以彌補價值上的差異，而這種交付的結算預計會在交易日 T+1 發生。儘管已制定對手方風險管理措施，但將產品對每名掉期對手方的風險承擔淨額維持於零須承受掉期未能結算引致的結算風險及市場風險（包括在掉期對手方向產品支付所需現金之前的價格變動）。掉期對手方於相關交易日 T+1 結束前向產品支付現金的任何延誤可導致產品不時對掉期對手方的風險大於零。倘該掉期對手方無力償債或違約，則此風險可能導致產品重大損失。

- *每日容量限額風險*：掉期對手方可能有每日容量限制，一旦達到該限制，產品調整掉期交易規模以獲取足夠敞口且實現其既定投資目標的能力可能會受到不利影響，進而影響產品的表現。如果產品由於與相關指數證券的兩倍 (2x) 槓桿表現掛鈎的掉期的可用性有限而無法獲得足夠的兩倍(2x)指數槓桿表現的投資，又或者如果產品無法調整掉期的規模，則產品可以其他措施（作為防禦措施），暫停增設申購或贖回，直至基金經理確定可獲得所需的掉期供應為止，或直至基金經理能夠調整掉期的規模。在暫停申購和贖回期間，產品可能以大幅高於或低於資產淨值的溢價或折價買賣。若上述情況導致根據產品的掉期的終止事件，加上與掉期供應有限的風險，可能令產品受到不利的影響。
- *掉期費用增加的風險*：產品將承擔掉期費用，掉期費用由基金經理與掉期對手方根據實際市場情況按每個個案商討及達成共識。現時的掉期費用僅為最佳估計，並可能偏離實際市場情況。在極端市況下，掉期對手方於相關對沖的融資成本可能大幅增加，並因而增加掉期費用。掉期對手方可能因此提高掉期費用，對產品造成不利影響。
- *提早終掉期風險*：在若干情況下，掉期可在相關協議條款下提早終止，而這可能使產品支付平倉費，進而對產品的表現造成不利影響。該等提早終止亦可能損害產品實現其投資目標的能力，以及引致產品重大損失。此外，產品可能因須與其他掉期對手方訂立類似掉期協議而面對成本增加。

4. 槓桿表現風險

- 產品將使用槓桿效應達到相等於指數回報兩倍(2x)的每日回報。不論是收益和虧損都會倍增。在若干情況下（包括熊市），單位持有人可能就該等投資取得些微或零回報，或甚至蒙受全盤損失。

5. 與投資於其他基金有關的風險

- 除產品收取的費用外，相關基金的管理公司可能收取額外的費用，產品可能涉及另一層面的費用。此外，儘管經理人將小心選擇並監察相關基金，概不保證相關基金的投資策略將會成功或將能達致其投資目標，其可能對產品的資產淨值造成不利影響。

6. 重新調整活動的風險

- 概不能保證產品能每日重新調整其投資組合以達到其投資目標。市場干擾、監管限制或極端的市場波動性都可能對產品重新調整其投資組合的能力造成不利的影響。

7. 流動性風險

- 產品的重新調整活動一般在相關 A 股市場交易日結束或接近結束時進行，以便盡量減低跟蹤偏離度。為此，產品在較短的時間間隔內可能更受市況影響，承受更大的流動性風險。

8. 即日投資風險

- 產品通常於營業日深交所收市或接近收市時重新調整。因此，投資時間不足整個交易日的投資者，其回報一般會大於或小於指數槓桿投資比率的兩倍(2x)，視乎從一個交易日結束時起直至購入之時為止的指數走勢而定。
- 如果發生重大的即日市場事件和／或指數的證券大幅下跌，掉期對手方為對沖相關資產的融資成本可能會巨大增加，進而增加掉期費用及對產品表現造成不利影響。在此情況下，產品可能因難以購入或出售掉期而未能達到其投資目標或重新適當地調整其投資組合。

9. 集中風險

- 產品的投資集中於特定地區（即中國內地）。產品之價值可能較具有更多元化投資組合的基金更具波動性。產品之價值可能更易受到影響中國內地市場的不利經濟、政治、政策、外匯、流動性、稅項、法律或監管事件的影響。

10. 中國內地市場風險

- 指數成分股為在深交所上市的公司，該市場屬新興市場。產品的投資可能涉及在較發達市場的投資一般不常有的增加風險及特殊考慮因素，例如流動性風險、貨幣風險／管制、政治及經濟不確定性、法律和稅務風險、結算風險、保管風險及可能高度波動。
- 中國的A股市場高度波動，亦可能出現潛在的結算困難。A股價格可大幅升跌，與較成熟的市場相比，其波動程度較大。如此波動程度可能導致A股暫停交易或中國當局實行其他措施以致影響基金單位的買賣/交易，從而對產品的價值造成不利影響。
- 中國內地的證券交易所一般有關暫停或限制任何證券在相關交易所進行交易。政府或監管機構亦可實施可能影響金融市場的政策。所有該等因素均可能對產品造成負面影響。

11. 與中國內地A股風險有關的風險

- 指數包括A股，而僅於A股可在深交所買賣之情況下，方能不時買賣相關A股。A股市場被視為波動不定（存在某一股票暫停交易或政府干預的風險），A股市場的高市場波幅及潛在的結算困難可能導致在A股市場交易的證券價格顯著波動，並從而可能對產品造成不利影響。

12. 波動性及與中國創業板市場相關之除牌風險

- 創業板市場上市公司（例如：創新或中小型企業（「中小企」））通常處於其發展初段，營運規模較小，營運歷史亦較短，業務模式較為不成熟及風險管理能力較弱，而且其業務通常有較高的不確定性及其表現較為波動。因此其穩定性及抵抗市場風險的能力或會較低。故此，創業板市場上市公司或較在主板上市的公司承受較高的市場波動性及風險。
- 基於在創業板市場上市的公司經營所屬行業有風險，傳統的估值方法未必完全適用於此等公司。在創業板市場流通的股份較少，故股價或會相對較易被操縱，並可能因市場投機炒賣而較為反覆波動。
- 針對在創業板上市的公司規則及法規，在盈利能力和股本方面的規定不如上交所主板嚴格。
- 在創業板上市公司發生退市可能更加常見以及快速。如本產品投資的公司退市，將會對本產品產生不利影響。

13. 交易時間差異風險

- 深交所與聯交所的交易時段時差，可能擴大單位價格相對其資產淨值的溢價／折讓水平，原因在於若深交所休市而聯交所開市，則未必能提供指數水平。

14. 人民幣貨幣和匯兌風險

- 產品可通過基金經理的RQFII資格投資人民幣定息證券及集體投資計劃，而相關交易則以人民幣結算；掉期對手方可以直接在中國大陸市場投資A股以作對沖其掉期限度，因此，產品可能受限於人民幣幣值相關風險。人民幣受外匯管制及限制，目前並非可自由兌換的貨幣。在特殊情況下，在一級市場中人民幣贖回收益款項及／或股息款項或會因適用於人民幣的外匯管制及限制而延遲發放。
- 儘管離岸人民幣（CNH）及在岸人民幣（CNY）為相同的貨幣，它們以不同匯率交易。CNH及CNY的任何差異可對投資者造成不利影響。
- 產品可能需要使用相關ISDA信貸支持附件所載的基礎貨幣以外的貨幣作為提供抵押品及初始金額用途。產品可能訂立貨幣合約對沖貨幣風險，但承擔的貨幣風險與掉期的市值掛鈎。這可能為產品帶來額外成本及貨幣風險。

15. 與債務證券相關的風險

- 利率風險：投資於產須承受利率風險。一般而言，利率下跌時，債務證券的價格會上升，利率上升時，其價格則會下跌。
- 發行者信用風險：本產品將承受其可能投資的債務所帶來之發行人信用／違約風險。

- 主權債務風險：產品投資於由政府發行或擔保的債務工具或須承受政治、社會及經濟風險。在不利的情况下，主權國發行人未必能夠或願意償還到期本金及／或利息，或可能要求產品參與該等債務重組。在主權債務發行人違責的情况下，產品可能蒙受巨額損失。
- 信用評級風險：評級機構指定的信用評級有所規限，並不保證證券及／或發行人在任何時候的信用可靠性。
- 評級下調風險：債務工具或其發行人的信用評級或會被下調。如有關評級遭下調，則本產品的價值或會受到不利影響。基金經理未必能夠出售評級被下調的債務工具。

16. 以資本或實際以資本支付分派的風險

- 以資本支付或實際以資本支付分派，等於投資者獲得部分原投資額回報或撤回其部分原投資額或可歸屬於該原投資額的資本收益，可能導致每單位資產淨值即時減少。

17. 被動式投資風險

- 產品是以被動方式管理，因此基於產品的內在投資性質，基金經理不能酌情對市場變化作出調適。相關指數下跌將引致產品的價值出現下跌。

18. 交易風險

- 單位在聯交所的成交價受諸如單位的供求等市場因素帶動。單位可能以資產淨值的大幅溢價或折價買賣。
- 由於投資者在聯交所購入或出售單位時將支付若干收費（例如交易費用及經紀費），這表示投資者在聯交所購買單位時可能須支付多於每單位資產淨值的款項及在聯交所出售單位時可能收到少於每單位資產淨值的款項。

19. 與 QFII 及 RQFII 制度有關的風險

- 產品可透過基金經理的 QFII／RQFII 身份投資於其他集體投資計劃。產品實現其投資目標及策略的能力或會因中國內地的適用法例、規則及規例（包括投資及匯出本金及利潤的限制）而受到影響，該等法規可能變更，而有關變更可能具有潛在追溯效力。
- 掉期對手方可能透過本身或第三方／聯屬公司的 QFII／RQFII 投資於 A 股的方式對沖其掉期風險。如掉期對手方因任何原因無法透過 QFII 或 RQFII 進行交易（例如由於 QFII／RQFII 的批准被撤回、終止或無效），可能妨礙掉期對手方增加相關掉期規模的能力，而這會影響產品實現其投資目標及策略的能力。如所有掉期對手方均出現此情況，產品可能停止接受認購，並可能導致單位以其資產淨值的溢價交易。在最差情況下，產品或會被終止。

20. 依賴市場莊家的風險

- 雖然基金經理將致最大努力落實安排至少有一名市場莊家為單位維持市場而且在有關做莊安排終止之前發出不少於三個月的通知，但若單位只有一名市場莊家，單位在市場的流動性可能受到不利影響。概不保證任何做莊活動均有效。

21. 跟蹤誤差及相關性風險

- 產品或會承受跟蹤誤差風險，此跟蹤誤差風險為產品表現未能準確跟蹤指數的每日兩倍（2x）槓桿表現。此跟蹤誤差風險可能因所採用的投資策略、使用掉期相關的成本、市場流通性及費用及支出，而產品表現與指數每日表現兩倍（2x）的相關性會減低。基金經理將監控及力求管理上述風險以盡量減低跟蹤誤差。概不能保證任何時候都能確切或完全複製指數的槓桿表現。

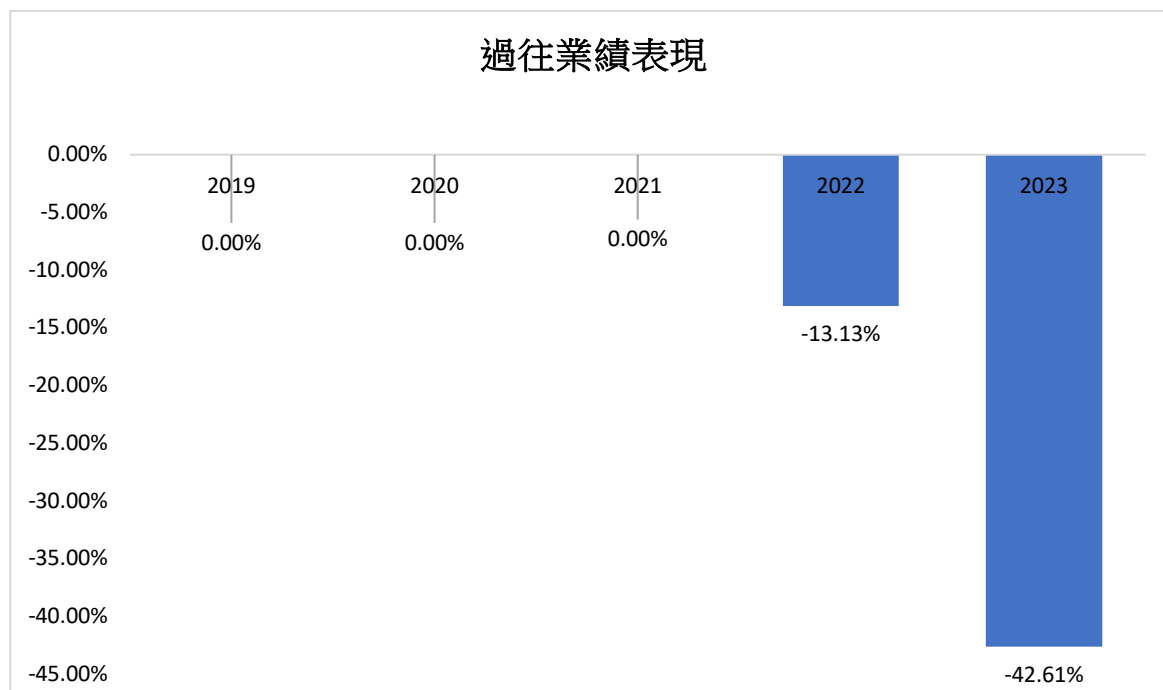
22. 波動性風險

- 由於槓桿的使用及每日重新調整活動，產品價格可能比傳統的交易所買賣基金更波動。

23. 終止的風險

- 產品在若干情況下或會提前終止，例如沒有市場莊家、指數不再可供作為基準或產品的規模跌至少於1,000萬美元。於產品終止時，投資者可能未能收回全部投資並蒙受損失。

本產品的表現如何？



- 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（如有）會滾存再作投資。
- 基金發行日: 2022年5月10日。2022基金年度表現是從2022年5月10日（基金成立日）開始計算。

本產品有否提供保證？

產品並不提供任何保證。閣下未必能取回投資本金。

投資本產品涉及哪些費用及收費？

在聯交所買賣產品的收費

費用	閣下須繳付的費用
經紀費	市場收費率
證監會交易徵費	0.0027% ¹
會計及財務匯報局交易徵費	交易價格的 0.00015% ²
聯交所交易費	0.00565% ³
印花稅	沒有

證監會交易徵費為單位成交價 0.0027%，由買方和賣方各自支付。

² 會計及財務匯報局交易徵費為單位成交價格的 0.00015%，由買方和賣方各自支付。

³ 單位成交價 0.00565% 的交易費，由買方和賣方各自支付。

產品持續繳付的費用

以下收費將從產品中扣除，閣下會受到影響，因為產品的資產淨值會因而減少，從而影響買賣價格。

	每年收費率（佔資產淨值百分比）
管理費*	1.48%
受託人費	0.1%，每月最少3,000美元
登記費	每月5,000港元
表現費	沒有
行政管理費	計入受託人費

* 請注意，管理費及受託人費可在向單位持有人發出一個月通知後增加，惟以允許的最高收費率為限。有關須支付的費用及收費及其允許最高收費率以及其他可能由產品承擔的持續費用的進一步詳情，請參閱章程「費用及支出」一節。

其他費用

閣下買賣產品的單位或須繳付其他費用。詳情請參閱章程。

其他資料

基金經理將以中、英文在基金經理的網址 www.bosera.com.hk/hk/products/funddetail/LI/overview?fundCode=ChiNextLI (並未經證監會審核或批准) 登載與產品(包括指數)有關的重要消息及資訊,包括:

- (a) 章程及本概要(不時修改);
- (b) 最新的年度賬目及半年的未經審核報告(只提供英文版);
- (c) 有關對產品的重大變更而可能對其單位持有人有影響的通知,例如章程或產品的組成文件作出重大修改或增補;
- (d) 產品作出的公告,包括與產品及指數有關的資料,及暫停計算資產淨值、暫停增設及贖回單位、更改收費及暫停和恢復買賣的通知;
- (e) 在聯交所交易時段每15秒更新一次的接近實時的每單位指示性資產淨值,以港元表示;
- (f) 產品於最後的資產淨值(以港元表示)及於最後的每單位資產淨值(以港元表示);
- (g) 產品的過往表現資料;
- (h) 產品的每日跟蹤偏離度、平均每日跟蹤偏離度及跟蹤誤差;
- (i) 產品的完整投資組合(每日更新一次);
- (j) 產品對每名掉期對手方的風險承擔總額及淨額;
- (k) 以圓形圖顯示抵押品的圖示資料(每星期更新),表明下列各項(如適用):**a)**按資產種類分項列明,例如股票、債券及現金和現金等價物;**b)**就股票而言,進一步按(1)一級市場上市(即證券交易所)、(2)指數成分股,及(3)行業分項列明;**c)**就債券而言,進一步按(1)債券種類、(2)發行人/擔保人的國家,及(3)信貸評級分項列明;
- (l) 抵押品的十大持股(包括股票名稱、佔產品資產淨值的百分比、種類、一級市場上市、發行人的國家、信貸評級(如適用))(每星期更新);
- (m) 掉期對手方的最新名單(包括掉期對手方及其擔保人(如適用)網址的連結)(每星期更新);
- (n) 「表現仿真分析」,允許投資者選擇過往時段並根據過往數據模擬有關產品於該時段對比指數的表現;
- (o) 參與證券商及市場莊家的最新名單;及
- (p) 產品於連續的12個月期內股息的組成(即從(i)可分派淨收入,及(ii)資本支付的相對款額)。

每單位資產淨值(以港元計價)在A股市場收市後維持不變。詳情請參閱章程。

過去十二個月單位應付股息的組成(即從(i)可供分派淨收入及(ii)資本)可向基金經理索取及於 www.bosera.com.hk/hk/products/funddetail/LI/overview?fundCode=ChiNextLI (並未經證監會審核或批准) 查閱。

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。