

南方東英資產管理有限公司

2025 年 5 月 2 日

- 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:	3443
每手交易數量:	100 個單位
基金經理:	南方東英資產管理有限公司 CSOP Asset Management Limited
受託人及過戶處:	滙豐機構信託服務（亞洲）有限公司
託管人:	香港上海滙豐銀行有限公司
指數:	富時強積金香港指數
全年經常性開支比率#:	0.10%
估計年度跟蹤偏離度*:	-0.15%
基本貨幣:	港元
交易貨幣:	港元
財政年度終結日:	12 月 31 日
派息政策:	每年派息，由基金經理酌情決定。基金經理目前擬於每年 12 月按照扣除費用與成本後的子基金淨收入派息。但不保證會定期派息及（如派息）所派發的金額。

基金經理可酌情從資本中或實際上從資本中作出派息。任何涉及從子基金資本中作出派息或實際上從資本中作出派息的分派均可能導致每單位資產淨值即時減少。所有單位僅會收取以港元計值的分派。

ETF 網址: <https://www.csopasset.com/tc/products/hk-cmpf>（此網站未經證券及期貨事務監察委員會（「證監會」）審閱）

由於子基金乃新成立，因此該數字僅為估計。此數字反映子基金在 12 個月內須支付的估計經常性開支，以佔子基金的估計平均資產淨值（「資產淨值」）的百分比表示。實際數字可能與估計數字不同，且每年均可能有所變動。在子基金推出後首年內，基金經理為子基金經常性開支數字以已披露的水平定立上限（「經常性開支上限」）。這代表在此期間，子基金任何屬於經常性開支範圍內的開支，如其將導致經常性開支數字超過經常性開支上限，基金經理將承擔該開支並將不計算入子基金內。

* 該數據為估計年度跟蹤偏離度。投資者應參閱 ETF 網站以獲得更加更新的實際跟蹤偏離度的資訊。

這是甚麼產品？

本基金根據香港法例成立以單位信託形式組成，為 CSOP ETF 系列二的子基金。南方東英富時香港股票 ETF（「子基金」）的單位在香港聯合交易所有限公司（「聯交所」）買賣（如同上市股份）。

子基金為根據《單位信託及互惠基金守則》（「《守則》」）第 8.6 章獲認可的被動式管理指數追蹤交易所買賣基金。

目標及投資策略

目標

子基金的投資目標是提供緊貼富時強積金香港指數（「**指數**」）表現的投資成績（扣除費用及開支前）。

策略

為了達至其投資目標，子基金採用實物代表性抽樣策略，將最多**100%**的資產淨值投資於與指數高度相關的代表性抽樣證券，惟成份股本身可能是或可能不是指數的成份股（「**指數證券**」）。

在採用代表性抽樣策略時，子基金可能會亦可能不會持有所有指數證券，且可能持有並非指數證券的其他證券。基金經理可安排子基金偏離指數權重，但條件是任何成份股偏離指數權重的最大程度不得超過**3%**，或基金經理在諮詢證監會後釐定的其他百分比。

基金經理亦可全權酌情在其認為適當的情況下，採取全面複製策略，按指數證券在指數內大致相同的比重（即比例），將子基金的所有或絕大部分資產直接投資於指數證券。倘基金經理從實物代表性抽樣策略轉換為全面複製策略，概不會事先通知投資者，反之亦然。

基金經理亦可將不多於**10%**的子基金資產淨值投資於金融衍生工具（「**金融衍生工具**」）（包括期貨及掉期）以作投資及對沖用途，惟基金經理須認為此等投資將有助於子基金達致其投資目標並對子基金有利。

子基金亦可將不多於**5%**的子基金資產淨值投資於現金及／或貨幣市場基金（根據《守則》第**8.2**章獲證監會認可的基金、根據《守則》第**7.11A**章的合資格計劃或不合資格計劃）作現金管理用途。

基金經理可將不多於**50%**的子基金資產淨值用以進行證券借出交易，預期水平約為**20%**的資產淨值。

子基金現時無意進行銷售及回購交易或逆向回購交易。倘子基金進行該等類別的交易，須事先尋求證監會批准（倘需要）及至少提前一個月通知單位持有人。

指數

指數是經修訂的自由流通量調整市值加權指數，包括在香港上市的滙豐控股，以及富時強積金環球指數中合資格的大型及中型香港公司及在香港上市的中國公司（**H 股**、**紅籌股**及**民企股**）。該等香港公司及在香港上市的中國公司應在香港強制性公積金計劃管理局（「**積金局**」）核准的證券交易所上市，其中包括香港聯合交易所有限公司及在香港以外設立並獲積金局核准的其他證券交易所。

指數中的每隻證券必須是富時環球指數¹的現有成份股（指數當中在香港上市的滙豐控股除外）。要納入富時環球指數，合資格證券必須通過多項篩選，當中包括最低投票權、可投資性權重篩選（如自由流通量和最低外資可投資餘額要求）以及流動性篩選。指數中的每隻證券均須按積金局的資格要求通過進一步篩選，包括在未經積金局核准的證券交易所上交易和上市的證券將被排除在計算之外，以得出富時強積金環球指數。此指數的建構包含符合上述資格標準的以下證券：滙豐控股（香港上市股份）、香港公司及在香港上市的中國公司（**H 股**、**紅籌股**及**民企股**）。

指數為淨總回報指數，即其表現是根據股息或分派經扣除任何預扣稅後再投資而計算所得。指數以港元計值及報價。指數於**2005 年 1 月 1 日**推出，其於**2000 年 11 月 30 日**的基準水平設為**5000**。截至**2025 年 3 月 31 日**，指數的淨市值為**190,370.9 億港元**及有**327 隻**成份股。

指數由富時羅素（「**指數提供者**」）編製及管理。基金經理（及其每名關連人士）獨立於指數提供者。

¹富時環球指數是市值加權指數，反映富時全球股票指數系列（**GEIS**）中型及大型股的表現。其目標是涵蓋用於構建 **GEIS** 指數範圍的 8 個地區之 **90%**，包括亞太區（不含中國和日本）、中國、歐洲成熟市場、歐洲新興市場、日本、拉丁美洲、中東、非洲及北美洲。

指數的成份證券名單及其各自的權重載於指數提供者的網站 <https://www.lseg.com/en/ftse-russell/index-resources/constituent-weights>（此網站未經證監會審閱）。指數的最新收盤水平、指數編算方法及其他資料載於指數提供者的網站 <https://www.lseg.com/en/ftse-russell/indices/mpf>（此網站未經證監會審閱）。

指數的實時更新可透過資訊供應商彭博和路透社根據以下列識別碼獲取：

彭博：TFMPFHH

路透社：.TFTGPMPF028H

運用衍生工具 / 投資衍生工具

子基金的衍生工具風險承擔淨額最多可達其資產淨值的 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. 一般投資風險

- 概不保證子基金將會達致其投資目標。子基金投資組合的價值可能因以下任何主要風險因素而下跌，因此閣下對子基金的投資可能會蒙受損失。概不保證能夠償付本金。

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

- 子基金的風險集中於香港市場。與投資組合較多元化的基金相比，子基金的價值可能較為波動，並且可能較容易受到對香港市場造成影響的經濟、政治、政策、外匯、流動性、稅務、法律或監管不利事件所影響。

4. 與香港上市中國公司有關的風險

- 子基金可投資於在香港上市的中國公司發行之 H 股、紅籌股或民企股。投資於該等證券須承受投資於新興市場的一般風險。這可能涉及一般與投資於更成熟市場的公司無關的更大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、法律及稅務風險、結算風險、託管風險，以及可能出現更大波動。
- 影響香港上市中國公司的新稅務法律、法規及慣例的頒布，可能對單位持有人有利或不利。適用香港上市中國公司的現行稅務法律、法規和慣例有可能在未來被修改並具有追溯效力。

5. 與證券借出交易有關的風險

- 證券借出交易可能涉及以下風險：借貸人可能無法及時歸還，甚至完全無法歸還借出的證券，而抵押品的價值可能跌至低於所借出證券的價值。

6. 被動投資風險

- 子基金以被動方式管理，而由於子基金的固有投資性質，基金經理並無酌情權針對市場變化作出應變。指數下跌預計將導致子基金資產淨值相應下降。

7. 跟蹤誤差風險

- 子基金僅持有與指數高度相關的代表性抽樣證券，並可能投資於未有列入指數的證券。因此，與其他完全複製指數的傳統 ETF 相比，子基金可能會出現更大的跟蹤誤差。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指數的表現。

8. 買賣風險

- 單位在聯交所的交易價格受市場因素（例如單位的供求）影響。因此，單位可能以資產淨值的大幅溢價或折價買賣。
- 由於投資者將支付某些費用（例如交易費和經紀費）以在聯交所買賣單位，因此投資者在聯交所購買單位時可能會支付超過每單位資產淨值，並且在聯交所賣出單位時可能會獲得低於每單位的資產淨值。

9. 終止風險

- 子基金可能於若干情況下被提前終止，如指數不再可用作基準，或子基金的規模減至人民幣 1.5 億元（或等值的子基金基本貨幣）以下。子基金終止時，投資者未必能取回其投資，並可能會蒙受損失。有關進一步詳情，投資者應參閱章程內「終止」一節。

10. 依賴市場莊家的風險

- 雖然基金經理將盡最大努力實施安排使最少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協議在終止市場莊家安排前給予不少於 3 個月的通知，但如以港元買賣的單位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。此外，概不保證任何市場莊家活動將會有效。

11. 有關從資本中撥付分派的風險

- 基金經理可酌情從資本中撥付股息。基金經理亦可酌情從總收入中撥付股息，而子基金的全部或部分費用及開支則從子基金的資本中支取/撥付，導致供子基金派付股息的可分派收入有所增加，子基金因此可實際上從資本中撥付股息。從資本中撥付股息或實際上從資本金額中撥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。
- 任何涉及從子基金的資本中撥付股息或實際上從資本中撥付股息，可導致每單位資產淨值即時減少。

本基金過往的業績表現如何？

由於子基金乃新設立，因此並無足夠的數據為投資者提供有關過往業績表現的有用指標。

有否提供保證？

本基金並不提供任何保證。閣下未必能取回投資本金。

有甚麼費用及收費？

在聯交所買賣子基金所產生的收費

費用	閣下所付金額
經紀費用	按市場費率
交易徵費	0.0027% ¹
會計及財務匯報局（「會財局」）交易徵費	0.00015% ²
交易費用	0.00565% ³
印花稅	無

¹ 交易徵費為單位成交價的 0.0027%，由每名買方及賣方支付。

² 會財局交易徵費為單位成交價的 0.00015%，由每名買方及賣方支付。

³ 交易費用為單位成交價的 0.00565%，由每名買方及賣方支付。

子基金應持續支付的費用

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的資產淨值，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*	0.10%
受託人、過戶處及託管費	包括在管理費內
表現費	無
行政費	包括在管理費內

其他持續支付的費用

有關子基金應付的其他持續支付的費用詳情，請參閱章程

* 務請注意，管理費可藉向單位持有人發出一個月的事先通知而增加至允許上限的金額。有關應付費用及開支及該費用所允許的最高金額以及子基金可能承擔的其他經常性開支的詳情，請參閱章程「費用及開支」一節。

其他費用

閣下買賣子基金單位時或須支付其他費用。請參閱章程以了解適用於增設或贖回單位或買賣單位的其他費用及開支的詳情。閣下亦應向中介人查核付款程序，包括閣下應用作結算該等費用的貨幣及如交易需作出任何貨幣兌換，匯率將如何釐定。

其他資料

閣下可於以下網站 <https://www.csopasset.com/tc/products/hk-cmpf>（其內容未經證監會審閱）瀏覽有關子基金的以下資料。

- (a) 章程及有關子基金的產品資料概要（經不時修改）；
- (b) 最新年度經審核帳目及半年度未經審核報告（僅提供英文版本）；
- (c) 有關章程、子基金的產品資料概要或子基金組成文件之重大修訂或增補的任何通知；
- (d) 任何由子基金向公眾作出的公告，包括有關子基金及指數的資料、暫停計算資產淨值、更改費用、暫停及恢復單位發行、增設及贖回單位和買賣單位的通知；
- (e) 於每個交易日接近實時（每 15 秒更新一次）的指示性每單位資產淨值（以港元計值）；
- (f) 子基金的最新資產淨值（以港元計值）及子基金的最新每單位資產淨值（以港元計值）（每日更新）；
- (g) 子基金的過往表現資訊；
- (h) 子基金的全部持倉（每日更新）；
- (i) 子基金的跟蹤偏離度及跟蹤誤差；
- (j) 參與交易商及市場莊家的最新名單；及
- (k) 最近 12 個月的股息組成（即從(i)可分派收入淨額及(ii)資本中撥付的派息金額及百分比）（如有）。

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。