

重要：此乃重要文件，務需閣下即時垂注。如有疑問，請尋求專業建議。

香港聯合交易所有限公司(「**聯交所**」)、香港交易及結算所有限公司、香港中央結算有限公司及香港證券及期貨事務監察委員會(「**證監會**」)對本公告之內容概不負責，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之任何損失承擔任何責任。

管理人為睿亞資產管理有限公司(「**睿亞資產**」)，對本公告所載資料的準確性承擔全部責任，並在作出一切合理查詢後確認，盡其所知所信，並無遺漏促以令本公告的任何陳述具誤導成分的其他事實。

證監會認可並非對該計劃作出推介或認許，亦非對該計劃的商業利弊或表現作出保證，不代表該計劃適合所有投資者，或認許該計劃適合任何個別投資者或任何類別的投資者。

投資涉及風險，包括損失本金。倘若閣下對本公告所載資料或投資於本公告所提述的基金有任何疑問，應向閣下的股票經紀、銀行經理、律師、會計師或其他財務或專業顧問諮詢獨立意見。

PREMIA MSCI 越南 ETF

(股份代號：2804 / 9804)

Premia ETF 系列的子基金
(根據香港證券及期貨條例(第 571 章)第 104 條
獲認可的香港單位信託基金)

通知及公告

Premia MSCI 越南 ETF 相關指數、基金名稱及 第六份補充契據中名稱的變更

Premia ETF 系列管理人睿亞資產管理有限公司（「**管理人**」）宣布自 2024 年 5 月 2 日（「**生效日期**」）起，(i) Premia MSCI 越南 ETF（「**子基金**」）的相關指數將更改為「標普越南核心指數 (美元) NTR」及；(ii) 子基金的英文名稱更改為 Premia Vietnam ETF，中文名稱更改為 Premia 越南 ETF（子基金的簡稱不變）（統稱「**變更**」）。此新指數成分股的重新調整將在生效日期起的 5 個交易日內進行。為免生疑問，子基金的投資目標及策略將不會改變。

本通知及公告（「**公告**」）所用之詞彙（並未界定）具列於 2024 年 1 月 22 日的 Premia ETF 系列基金說明書（「**基金說明書**」）之相同含義。基金說明書可在 Premia ETF 系列網站 www.premia-partners.com¹ 及香港交易所披露易網站 www.hkexnews.hk¹ 查閱。

子基金相關指數的變更

自生效日期起，子基金的相關指數將從 MSCI 越南指數（「**現有指數**」）變更為「標普越南核心指數 (美元) NTR」（「**新指數**」）。該變更將從生效日期交易時開始。新指數成分股的重新調整預計將在生效日期起的 5 個交易日內進行，最遲於 2024 年 5 月 8 日結束。有關重新調整的更多資訊，請參閱下面 C 部分。

A. 新指數資訊及現有指數與新指數的比較

新指數由標普道瓊斯指數有限公司計算和發佈。新指數資訊摘要請參閱公告附錄 1。以下為現有指數與新指數主要特徵的比較：

	MSCI越南指數 (現有指數)	標普越南核心指數 (美元) NTR (新指數)
指數供應商	MSCI Inc.	標普道瓊斯指數有限公司

¹ 該網站內容未經證監會審核。

投資領域	現有指數量度越南市場大中型股票的表現，旨在涵蓋MSCI越南可投資市場中可投資股票範圍的約85%。而MSCI 越南可投資市場目標涵蓋所有越南上市公司經自由流通量調整後的99%市值。	新指數旨在量度標普越南BMI指數（「 母指數 」） ² 中規模最大、流動性最高的股票表現，涵蓋母指數經自由流通量調整後的市值（「 流通市值 」）約90%。母指數標普越南BMI指數是一個綜合指數，涵蓋了所有符合標普前沿市場指數的指數計算方法所定義的納入門檻 ³ 的越南公司，旨在涵蓋越南股市的80%總市值。
指數計算方法	<p>現有指數的指數建構和維護受MSCI 全球可投資市場指數計算方法管轄，該指數計算方法定期更新，可在MSCI 網站 www.msci.com¹ 上查看。</p> <p>重新調整：現有指數的組成在5月和11月的半年度指數審核（「半年度指數審核」）以及2月和8月的季度指數審核（「季度指數審核」）中進行審核。半年度指數審核旨在有系統地按照固定的半年度時間表重新評估所有市場股票領域的各個維度變化，而季度指數審核旨在反映重大市場驅動</p>	<p>新指數的指數建構和維護受標普前沿指數計算方法管轄，該指數計算方法定期更新，可在標普網站 https://www.spglobal.com/spdji/en/indices/equity/sp-vietnam-core-index¹ 上查看。</p> <p>重新調整：年度重新調整在3月的第三個星期五收盤時進行，屆時新指數會按照成分股篩選流程，從指數範圍中選出至少30家合資格的公司。重新調整參考日為同年2月的第三個星期五。此外，季度重新加權在6月、9月和12月的第三個週五結束時進行，屆時會審查指數權重，以確保權重參數符合指數計算方法要求，一般</p>

² 母指數的範圍包含越南公開上市的股票，目標達至總市值的80%，並須符合規模和流動性標準。在每次年度重新調整時，指數範圍都涵蓋越南當地交易所上市的所有股票。所有公開上市的多種股票類別均有資格被納入指數，但須符合資格標準。所有可投資的一級市場股票類別均被考慮納入母指數。每個股票類別均根據特定的可投資權重系數進行流通量調整。

³ 納入門檻包括：

1. 母指數中每個指數成分股的流通市值不得低於1億美元，年度交易價值（「**年度交易價值**」）不得少於3,500萬美元；並且
2. 如未達至80%的目標市場覆蓋率，則流動性要求可能會被放寬，以納入在過去12個月內至少有120天錄得交易的公司。年度交易價值小於或等於100萬美元的股票不包括在市場覆蓋範圍內。

每次重新調整時，符合條件的股票將構成母指數，並有50%的流通市值和年度交易價值的緩衝。現有成分股只要保持流通市值至少為5,000萬美元，及年度交易價值至少為1,750萬美元，可維持其納入資格。

	<p>的改變發生時，現有指數編制並未即時反映，而足以影響下個半年度指數審核的情況。</p> <p>半年度指數審核期間，股票範圍將同時更新，同時用於劃分市場規模結構的全球最小規模區間值亦會作相應重新計算。</p> <p>持續審查：</p> <p>持續審查有關合併、收購、分拆、破產、重組和其他類似的公司事件所導致的現有指數變化，一般在事件發生時同步進行。符合早期納入條件的重大IPO一般會在公司第十個交易日收盤後納入現有指數。</p>	<p>不會添加或刪除成分股。用於計算權重的價格參考日期為重新調整/重新計算權重之月份的第二個星期五前的星期三。</p> <p>持續審查：</p> <p>為了持續審查，標普道瓊斯指數委員會（「指數委員會」）可能會在每次會議上審查可能影響新指數成分股但懸而未決的公司行動、比較指數構成與市場情況的統計數據、作為新指數增補的候選公司、以及任何重大市場事件。此外，指數委員會可能會修訂指數政策，包括篩選公司的準則、股息處理、股票數量或其他事項。</p>
指數自由流通量調整後市值	329.7 億美元	300.8 億美元
成分股數量	56	51
前 5 名成分股及其權重	<ol style="list-style-type: none"> 1. Hoa Phat Group JSC (權重 10.87%) 2. Vinhomes JSC (權重 8.14%) 3. 越南外貿銀行股份公司 (權重 6.69%) 4. 越南乳製品股份公司 (權重 6.48%) 5. Vingroup JSC (權重 6.35%) 	<ol style="list-style-type: none"> 1. Hoa Phat Group JSC (權重 11.91%) 2. 越南外貿銀行股份公司 (權重 7.33%) 3. 越南乳製品股份公司 (權重 7.31%) 4. Masan Group Corp (權重 6.25%) 5. 西貢證券公司 (權重 5.84%)
指數代碼	MSEIVTUN	SPVIECUN

現有指數及新指數的數據截至 2024 年 2 月 29 日。

管理人相信，相關指數的變化將增強子基金的投資並分散風險，尤其新指數針對傾向主導指數市值的成分股集中度較低，包括 Vingroup 集團（例如 Vinhomes JSC、Vingroup JSC 和 Vincom Retail JSC）⁴。這將降低這些公司的集中風險，更能反映投資者對組合行業配置的需求，透過實現更多元化和廣泛的市場配置降低集中風險，並為單位持有人帶來多元化效益，尤其針對波動性風險指標的優化，提供更適當的整體投資配置。另一方面，兩個指數的投資範圍存在高關聯性，因此管理人認為新指數適合取代現有指數⁵。

投資者應注意，概不保證(i)兩個指數日後的相關性及(ii)指數變更後子基金的回報。

B. 子基金名稱變更

由於相關指數變更，子基金的名稱亦將自生效日期起變更。自生效日期起，子基金的全稱和簡稱將會如下：

	截至本公告日期	自生效日期起
股票代碼	09804 –美元櫃台 02804 –港元櫃台	09804 –美元櫃台 02804 –港元櫃台
英文名稱	Premia MSCI Vietnam ETF	Premia Vietnam ETF
中文名稱	Premia MSCI 越南 ETF	Premia 越南 ETF
英文簡稱	美元櫃台: PREMIA VIET-U 港元櫃台: PREMIA VIET	美元櫃台: PREMIA VIET-U 港元櫃台: PREMIA VIET
中文簡稱	美元櫃台: P P 越南 – U 港元櫃台: P P 越南	美元櫃台: P P 越南 – U 港元櫃台: P P 越南

為免生疑問，儘管相關指數於生效日期發生變更，子基金的股票代碼、簡稱、交易金額及 ISIN 則不會改變。

⁴ 截至 2024 年 2 月 29 日，在現有指數中，Vingroup 公司各自的權重如下：

Vincom Retail JSC = 3.04% / Vingroup JSC = 6.35% / Vinhomes JSC = 8.14%

而在新指數中，這些公司的權重為：

Vincom Retail JSC = 3.33% / Vingroup JSC = 5.09% / Vinhomes JSC = 5.10%

⁵ 單位持有人應注意，新指數的單一成分股上限為 15%，而現有指數則沒有相同的上限。新指數還規定了外資持股比例最低限制為 10%（納入）和低於 5%（排除），而現有指數的最低外資持股比例為 25%（納入但不調整權重）和低於 3.75%（排除）。

C. 重新調整程序

子基金持有的資產將自生效日期開始由現有指數成分股調整至新指數成分股，預計需時 5 個交易日（「**重新調整期**」）。在重新調整期間，子基金的追蹤誤差和追蹤差異可能高於其歷史水平。投資者應注意，於重新調整期後，概不保證子基金的追蹤誤差和追蹤差異將與變更前相若。

管理人並不預計重新調整會對市場產生任何重大影響。

有關重新調整期涉及的風險，請參閱附錄 2。

D. 風險因素

如上所述，重新調整期可能存在風險。一般而言，重新調整期亦涉及與相關指數變化相關的風險，尤其是新指數的風險。潛在風險因素請參閱本公告附錄 2。

對子基金的影響

變更不會對現有單位持有人的權利或利益造成重大損害，除重新調整期風險、過往表現風險及子基金變動後的新指數風險外，整體風險狀況不會有任何增加。

經過上述變更後，

- 子基金的管理費將維持不變；且
- 有關子基金過往表現的資訊將繼續顯示在子基金的产品資料概要（「**產品資料概要**」）。但投資者應注意，由於本公告所述的變更，生效日期前市場狀況產生之相關業績表現將不再適用。

管理人並不預計子基金的持續收費和追蹤差異會有實質變化。最新數據目前已披露並將繼續在子基金網站 www.premia-partners.com¹ 上披露。管理人將監控持續收費和追蹤差異，並在必要時根據證監會的相關指引，更新產品資料概要中的數據。管理子基金的費用水平/成本不會有任何變化，且本公告中所述的變化預計不會影響子基金的營運和/或管理方式（除上文 C 部分中提到的重新調整）。

子基金持有的資產自現有指數成分股重新調整為新指數成分股的相關費用將由子基金承擔。實施變更（包括子基金相關指數的變更及子基金名稱的變更）相關的費用將由管理人承擔。管理人預期該等變更不會對子基金的淨值造成任何重大影響，亦不會對單位持有人造成任何重大不利影響。

本公告所述的變更毋須單位持有人批准。

子基金名稱變更

自 2024 年 5 月 2 日起，為配合信託子基金相關指數的變更，子基金的名稱將從「Premia MSCI 越南 ETF」改為「Premia 越南 ETF」。

信託的第六份補充契據（「**第六份補充契據**」）將透過經修訂及重述的第六份補充契據進行修訂，以更改子基金的名稱。

根據《信託契據》及適用法律法規，第六份補充契約的修改毋須獲得單位持有人的批准。受託人同意信託契據的修改。

一般資訊

上述變更、子基金經修訂的基金說明書及產品資料概要將於 2024 年 5 月 2 日於子基金網站 www.premia-partners.com¹ 及香港交易所網站 www.hkex.com.hk¹ 上發佈。基金說明書、產品資料概要及本公告亦可於下述的管理人辦事處免費查閱或購買。

閣下如對本公告或 Premia ETF 系列有任何疑問，請與我們聯絡：香港中環都爹利街 13 號樂成行 12 樓，電話號碼(852) 2950 5777，傳真號碼(852) 2950 5700，或發送電子郵件至 enquiries@premia-partners.com。

Premia ETF 系列的管理人
睿亞資產管理有限公司

日期：2024 年 4 月 2 日

附錄 1

新指數資訊摘要

指數的一般資訊

子基金的新指數為標普越南核心指數 (美元) NTR。新指數旨在量度標普越南 BMI 指數 (「**母指數**」) 中規模最大、流動性最高的股票表現。母指數是一個綜合指數，涵蓋了所有符合標普前沿市場指數的指數計算方法所定義的納入門檻的越南公司。

母指數的範圍包含越南公開上市的股票，目標達至總市值的 80%，並須符合規模和流動性的條件。在每次年度重新調整時，指數範圍都涵蓋越南當地交易所上市的所有股票。所有公開上市的多種股票類別均有資格被納入指數，但須符合資格標準。所有可投資的一級市場股票類別均被考慮納入母指數。每個股票類別均根據特定的可投資權重系數進行流通量調整。

納入門檻包括：

1. 母指數中每個指數成分股的流通市值不得低於 1 億美元，年度交易價值 (「**年度交易價值**」) 不得低於 3,500 萬美元；並且
2. 如果未達到 80% 的目標市場覆蓋率，則流動性要求可能會被放寬，以納入在過去 12 個月內至少有 120 天錄得交易的公司。年度交易價值小於或等於 100 萬美元的股票不包括在市場覆蓋範圍內。

每次重新調整時，符合條件的股票都會構成母指數，並有 50% 的流通市值和年度交易價值的緩衝。現有成分股只要保持流通市值至少為 5,000 萬美元，及年度交易價值至少為 1,750 萬美元，可維持其納入資格。

截至 2024 年 2 月 29 日，新指數共有 51 檔成分股，涵蓋母指數流通市值約 90%。此指數計算方法由標普道瓊斯指數有限公司 (「**標普**」或「**指數供應商**」) 構建。

標普建構、維護、授權和銷售證券市場指數，作為可投資產品 (如交易所交易基金 (ETF)、共同基金和結構性產品) 的基準。管理人 (及其每位關連人士) 獨立於指數供應商。

睿亞資產已與指數供應商簽訂授權協議，以使用新指數作為相關指數。睿亞資產免費將相關指數的權利轉授給信託。

新指數是一項浮動調整流通市值淨總回報 (「**流通市值**」) 指數。淨總回報指數根據股息或分配在扣除任何可能適用的預扣稅後進行再投資來計算指數成分股的表現。新指數以美元計價和報價，採用倫敦證券交易所集團提供的悉尼時間下午 4:17 提供的美元/越南盾即期匯率。

截至 2024 年 2 月 29 日，該指數由 51 檔成分股組成，流通市值約 300.8 億美元。前 5 名成分股及其權重如下：

1. Hoa Phat Group JSC (權重 11.91%)
2. 越南外貿銀行股份公司 (權重 7.33%)
3. 越南乳製品股份公司 (權重 7.31%)
4. Masan Group Corp (權重 6.25%)
5. 西貢證券公司 (權重 5.84%)

新指數於 2024 年 3 月 25 日推出，截至 2017 年 3 月 17 日的回溯基準為 1,000 點。

新指數目前可在彭博社獲取，代碼為 SPVIECUN (NTR, 美元)。新指數的收市價將於指數供應商的網站 <https://www.spglobal.com/spdji/en/indices/equity/sp-vietnam-core-index>¹ 上公佈。

指數計算方法

新指數的指數建構和維護受標普前沿指數指數計算方法管轄，該指數計算方法定期更新，可在 S&P 網站 <https://www.spglobal.com/spdji/en/indices/equity/sp-vietnam-core-index>¹ 上查閱。

合資格證券

新指數的選擇範圍僅包括於以下證券交易所上市的母指數成分股股票：

- 胡志明證券交易所；
- 河內證券交易所

母指數僅包含在上述兩家證券交易所上市的證券。

選擇標準

截至重新調整參考日，每隻合資格證券其 6 個月內日均交易額中位數必須不低於 250 億越南盾（現有成分股為 200 億越南盾），才能被納入新指數。低於 200 億越南盾的股票將在每個重新調整日從新指數中刪除。

每次重新調整時，新指數都會從指數範圍中選擇至少 30 家符合條件的公司，目標是達到母指數流通市值的 90%（根據所選公司的流通市值除以母指數的流通市值計算）並依照以下流程進行選擇緩衝：

1. 依照流通市值對符合條件的股票進行降序排列，依序選擇符合條件的公司，直至達到母指數流通市值的 87%。
2. 選擇目前排名在 87% 至 93% 之間的成分股，直到達到 90% 的目標。
3. 如果在步驟 2 之後未達到 90% 的目標，則按排名順序選擇最大的合資格公司（尚未包括在前面的步驟中），直到達到 90% 的目標。

4. 如果成分股數量少於 30 家，則選擇最大的合資格公司（根據先前的步驟尚未納入的），直至達到 30 家的最低股票數量。如果符合資格的公司少於 30 家，則新指數將包含少於 30 家成分股。

在每個季度重新加權時，會審查指數權重以確保權重參數符合指數計算方法要求。一般而言，這程序不會增加或刪除成分股。不過，如有需要，指數權重會進行重新調整。

新指數採用流通市值加權，單一公司權重上限為 15%。任何多餘的加權將按比例重新分配給未封頂的成分股。新指數也受到 10%（納入）和 5%（排除）的最低外資持股的限制。

指數調整

重新調整

年度重新調整在 3 月第三個星期五收盤時進行，新指數按照成分股選擇流程從指數範圍中選擇至少 30 家合資格的公司。重新調整參考日為同年 2 月第三個星期五。此外，季度重新加權在 6 月、9 月和 12 月的第三個星期五收盤時進行，屆時會審查指數權重，確保權重參數符合指數計算方法要求，一般不會添加或刪除成分股。用於計算權重的價格參考日期為重新調整/重新計算權重之月份的第二個星期五前的星期三。

持續審查

為了持續審查，標普道瓊斯指數委員會（「**指數委員會**」）可能會在每次會議上審查可能影響新指數成分股但懸而未決的公司行動、比較指數構成與市場情況的統計數據、作為新指數增補的候選公司、以及任何重大市場事件。此外，指數委員會可能會修訂指數政策，包括篩選公司的準則、股息處理、股票數量或其他事項。

公司行動

從母指數中剔除的成分股將同時從新指數中剔除。

分拆出來的公司如被認為不符合資格，會在正常交易至少一天後被剔除。除分拆外，指數不會在指定調整時間之外增加成分股。因退市、收購或任何其他公司事件導致股票從新指數中剔除，將導致新指數中其餘股票的權重發生變化。相對權重將保持不變。

指數治理

指數委員會負責維護指數。所有委員會成員都是標普道瓊斯指數公司的全職專業人員。該委員會定期舉行會議。在每次會議上，指數委員會會審查可能影響指數成分股但懸而未決的公司行動、比較指數構成與市場情況的統計數據、作為新指數增補的候選公司、以及任何重大市場事件。此外，指數委員會可以修改指數政策，包括篩選公司的準則、股息處理、股票數量或其他事項。

指數的指數證券

閣下可從指數供應商的網站 <https://www.spglobal.com/spdji/en/indices/equity/sp-vietnam-core-index>¹ 取得新指數的重要新聞、最新的成分股名單（及其各自的權重）以及新指數的表現數據。

指數授權協議

新指數授權的初始期限將於 2024 年 5 月 2 日開始，並持續至 2029 年 5 月 1 日，屆時授權會連續續簽 3 年，除非授權協議的任何一方不少於當前期限結束前 90 天向另一方發出書面終止通知。授權協議可以根據授權協議的條款另行終止。

附錄 2

風險因素

A. 與重新調整期相關的風險

重新調整期預計在 5 個交易日進行，子基金的持有資產將由現有指數成分股調整至新指數成分股。儘管現有指數與新指數之間存在高關聯性，但管理人認為子基金在重新調整期間的追蹤誤差和追蹤差異風險可能會增加。投資者於重新調整期間買賣子基金單位時，應謹慎行事。

B. 過往業績表現風險

由於指數變動，子基金在生效日期之前的過往表現是在自生效日期起不再適用的情況下取得的。投資者在考慮子基金在生效日期前的過往表現時應謹慎行事。

C. 新指數風險

新指數是 2024 年 3 月 25 日才推出的新指數。因此，相比追蹤更悠久、營運歷史較長的指數的其他指數基金，子基金或具有較高的風險。