

重要：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**」)對本通知之內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並表明不會就本通知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**」)，對本通知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，並無遺漏促以令本通知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。倘若閣下對本通知所載資料或投資於本通知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 中國房地產美元債 ETF

(股份代號：3001 / 83001 / 9001)

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

追蹤差異的偏差 Premia 中國房地產美元債 ETF

睿亞資產管理有限公司（「睿亞資產」）作為 Premia ETF 系列的管理人，謹此公告在 2022 年第四季度，Premia 中國房地產美元債 ETF（「子基金」）的年化追蹤差異偏離子基金的發售文件和網站所披露的估計年度追蹤差異。

本通知及公告所用之詞彙（並未界定）具列於 2023 年 2 月 3 日的 Premia ETF 系列基金說明書（定義為「**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.hk 查閱。

子基金銷售文件和網站披露的年化追蹤差異的偏差

本公告旨在通知子基金的投資者，截至 2022 年 12 月 30 日，子基金相比於 ICE 1-5 Year USD China Senior Real Estate Corporate Constrained Index (子基金的相關指數（「**指數**」））的年化追蹤差異為 -9.10%（「**年化追蹤差異**」）。根據子基金發售文件所披露，基於歷史模式的年化追蹤差異偏離估計年度追蹤差異的 -2.5%（「**估計追蹤差異**」）。

在 2022 年期間，尤其是在 2022 年最後一個季度，子基金經歷了非常波動的市場狀況，導致指數成分股的買賣差價高於正常水平。某些成分股的交易價格也處於極端水平，導致子基金的交易成本大幅增加，而這並沒有反映在指數中。

雖然指數假定指數重新平衡可以按指數的評估價格進行，但子基金可能無法這樣做，從而導致交易成本和交易摩擦。年化追蹤差異在很大程度上反映了子基金的執行成本。

為子基金及其投資者的最佳利益行事並在基金說明書的限制下，管理人努力避免在交易成本暫時飆升期間以異常高的價格複製指數的某些不良資產。管理人將這些不良資產的指數重新平衡交易推遲幾天，以便獲得更好的定價，並隨著時間的推移降低對追蹤誤差的影響。該決定旨在保護投資者的利益免受極端價格波動和投資者可能不得不遭受的即時損失。管理人一直審慎並在所有重要時間持續監察市場狀況。然而，鑑於動蕩的市場狀況持續時間超過預期，基金不可避免地無法完全避免所有指數重新平衡交易期間價格波動不穩定的影響，導致我們在 2022 年底觀察到的年化追蹤差異。

以上導致子基金的年化追蹤差異在相關期間偏離估計追蹤差異。

¹ 本網站未經證監會審核。

子基金在 2023 年 1 月的最新追蹤差異為 +1.1%（子基金的表現為 16.9%，而指數的表現為 15.8%）。由於債券市場從 2023 年 1 月以來從非常低迷的水平復蘇以及子基金的經紀商報出的價格更具競爭力，自成立以來的追蹤差異隨著時間的推移而改善。

管理人將繼續監察子基金的追蹤差異，該等差異將定期於子基金的網站更新。管理人亦會持續監察市場狀況，以期縮小追蹤差異。

若閣下對本通知及公告或 Premia ETF 系列有任何疑問，請與我們聯絡，地址為香港中環都爹利街 13 號，樂成行 12 樓，電話號碼(852) 2950 5777，傳真號碼(852) 2950 5700，或透過電郵 enquiries@premia-partners.com。

睿亞資產管理有限公司
Premia ETFs 管理人

日期: 2023 年 2 月 28 日