

南方東英資產管理有限公司

2024 年 4 月 26 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:	3033
每手交易數量:	200 個單位
基金經理:	南方東英資產管理有限公司
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
相關指數:	恒生科技指數
基本貨幣:	港元 (「港元」)
交易貨幣:	港元
本基金的財政年度終結日:	12 月 31 日
派息政策:	由基金經理酌情決定。目前基金經理擬經考慮每年(於十二月)向單位持有人分派收入。分派可以資本或實際以資本支付,及會減低子基金的資產淨值。
全年經常性開支比率#:	1.04%
上一曆年的跟蹤偏離度##:	-0.94%
子基金網址:	<a href="http://www.csopasset.com/tc/products/co-chst">http://www.csopasset.com/tc/products/co-chst</a> (網址未獲證監會審閱)

# 經常性開支比率是根據截至 2023 年 12 月 31 日的年度費用計算。每年均可能有所變動。

## 該數據為上一曆年的實際跟蹤偏離度。投資者應參閱子基金網站以獲得更加更新的實際跟蹤偏離度的信息。

#### 這是甚麼產品?

南方東英恒生科技指數 ETF (「子基金」) 是 CSOP ETF 系列\* (\*此傘子基金包含合成交易所買賣基金) (「本信託」) 的一個子基金, 而本信託是根據香港法例成立的傘子單位信託。子基金乃根據《單位信託及互惠基金守則》第 8.6 章認可的被動式管理指數追蹤基金。子基金的上市類別單位猶如股票一樣在香港聯合交易所有限公司 (「聯交所」) 買賣。

子基金提供上市類別單位 (「上市類別單位」) 及非上市類別單位 (「非上市類別單位」)。本概要載有關於發售上市類別單位的資料, 而除另有指明外, 本概要凡提及「單位」均指「上市類別單位」。有關非上市類別單位的資料, 投資者應參閱另一份概要。

## 目標及投資策略

### 目標

子基金的投資目標是提供緊貼相關指數（即恒生科技指數（「**相關指數**」））表現的投資成績（扣除費用及開支前）。概不保證子基金將會達致其投資目標。

### 投資策略

為了達致子基金的投資目標，基金經理主要採取全面複製策略，按組成相關指數的證券（「**指數證券**」）在相關指數內大致的相同比重（即比例），將子基金的所有或絕大部分資產直接投資於此等指數證券。

在特殊情況下（即由於限制、暫停交易、某些指數證券的有限可用性），當由於限制或有限供應，而導致購買相關指數成分的某些證券不可行，及/或當相比於子基金的資產淨值，使用全面複製策略不符合成本效益時，基金經理或使用具代表性抽樣策略投資於：

- (i) 表現與相關指數密切相關的具代表性樣本，惟成分可能或可能不是相關指數的組成部分；及/或
- (ii) 其他集體投資計劃（CIS）。「CIS」是指交易所買賣基金及/或非上市指數跟踪基金，追蹤與相關指數高度相關的指數。子基金投資其他 CIS 的上限不得超過子基金資產淨值的 10%，且根據守則的規定，子基金不得持有超過任何一個 CIS 發行單位的 10%。

倘基金經理在特殊情況下從全面複製策略轉換為具代表性抽樣策略，概不會事先通知投資者，反之亦然。若非由於指數重新調整或指數相關的公司行為而在投資組合中持有相關指數的任何非成份股，為提高透明度，基金經理將在買入後立即在其網站上披露這些非組成證券和其他 CIS 的名稱和購買權重，並於賣出之前每日報告。

基金經理可代表子基金進行最多達資產淨值的 50%，預期為淨資產值的約 20% 的證券借貸交易，且能隨時收回借出證券。作為證券借貸交易的一部分，子基金必須收取現金及/或非現金抵押品，其價值最少須為所借出證券價值（包括利息、股息及其他後續權利）的 100% 及須每日進行估值。

抵押品由受託人或受託人指定的代理人保管。所收取的非現金抵押品不可出售、再作投資或質押。所收取的現金抵押品的任何再投資須遵守守則所載之規定。

倘子基金進行證券借貸交易，所有產生的收益（在扣除直接及間接開支，在適用的法律和監管要求允許的範圍內，作為就證券融資交易所提供的服務支付合理及正常補償）後，應退還予子基金。

子基金不會投資於衍生工具（包括結構性存款、產品或工具）作投資或對沖用途，或於銷售及回購和逆向回購交易或其他類似場外金融衍生品交易。子基金亦可將其不多於 5% 的資產淨值投資於現金及貨幣市場基金作現金管理用途。

## **相關指數**

相關指數是一項流通市值加權指數，其目的乃代表最大 30 間與特定科技主題高度相關的香港上市公司，包括網絡（包括移動通訊）、金融科技、雲端、電子商貿或數碼（而個別非外國公司成份股的比重上限為 8%，個別外國公司成份股的比重上限為 4%，合計外國公司成份股的比重上限為 10%）。相關指數的選股範疇之證券包括於香港交易所主板上市之股票，但不包括第二上市的外國公司和根據香港交易所主板上市規則第 21 章上市之投資公司。「外國公司」是指 (i) 在香港以外註冊成立的公司；(ii) 非中國內地公司（即非 H 股、紅籌股及民企股公司）；(iii) 歷史、總部、管理層及/或主要營業地點位於香港、澳門、中國內地或台灣以外的公司。

相關指數由恒生指數有限公司（「**恒生指數公司**」）編製及管理。基金經理及其關連人士獨立於恒生指數公司。

相關指數屬淨總回報指數，即相關指數成份股的表現乃按照任何股息或分派經扣除預扣稅（如有）後再投資而計算得來。相關指數以港元計值及報價。

相關指數於 2020 年 7 月 27 日推出，於 2014 年 12 月 31 日的基準水平設為 3,000。截至 2024 年 3 月 22 日，相關指數擁有自由流通市值總額 17,802.2 億港元及 30 隻成份股。

相關指數成份股及其各自的權重以及相關指數的其他信息載於以下網站：  
<https://www.hsi.com.hk/eng/indexes/all-indexes/hstech>（該網站未經證監會審閱）。

彭博指數代碼: HSTECHN

## **運用衍生工具 / 投資衍生工具**

子基金將不會運用衍生工具作任何用途。

## **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. 投資風險**

- 子基金並不保證本金獲得償付，而閣下的投資或會蒙受損失。概不保證子基金將會達致其投資目標。
- 子基金並非以積極的方式管理。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。相關指數下跌預期會導致子基金的價值相應下跌。

### **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. 新指數風險**

- 相關指數屬新指數。與其他跟蹤有較長運作歷史且較具規模的指數的交易所買賣基金相比，子基金或須承受較高風險。

#### **4. 與科技主題公司有關的風險**

- 子基金的投資主要集中在科技主題公司。許多與科技主題高度相關的公司擁有相對較短的經營歷史。而與其他經濟行業相比，科技公司的特點是價格表現波動較大。科技行業的公司亦面臨激烈的競爭，政府也可能會進行大量干預，這可能會對利潤率產生不利影響。快速變化可能會使該等公司所提供的產品和服務過時。該等公司亦面臨知識產權或授權丟失或損害的風險，以及其他網絡安全風險，會導致不利的法律、財務、運營及聲譽影響。
- 子基金的價值可能比具有更多元化投資組合的基金更為波動。
- 子基金可能面臨與不同科技行業及主題相關的風險（包括工業、非必需性消費、醫療保健、金融、資訊科技、網絡（包括移動通訊）、金融科技、雲端、電子商貿或數碼）。這些行業或主題公司的業務下滑可能會對子基金造成不利影響。

#### **5. 地區集中風險**

- 相關指數跟踪大中華地區證券的表現（包括於大中華地區註冊成立的、大部分收入來自大中華地區的及其主要營業地點位於大中華地區的），因此相關指數會面對集中風險。相較於那些基礎更為廣泛的基金（例如全球性或區域性基金）而言，子基金的資產淨值可能面對更高的波動性，因為相關指數更容易受到該單一地區不利情況所帶來的價值波動所影響。

#### **6. 與證券借貸交易有關的風險**

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

#### **7. 依賴市場莊家的風險**

- 雖然基金經理致最大努力實施安排使保最少會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協議前給予不少於 3 個月的通知，但如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。亦概不保證任何市場莊家活動將屬有效。

#### **8. 上市及非上市類別單位交易安排不同的風險**

- 上市及非上市類別的投資者受不同的定價及交易安排規限。由於適用於各類別的費用及成本不同，上市及非上市類別各自的每單位資產淨值可能不同。上市及非上市類別單位的截止交易時間亦有所不同，並受適用的估值時間規限。
- 上市類別單位按即日現行市價（可能偏離相應的資產淨值）在證券交易所買賣，而非上市類別單位則透過中介人按交易日日終資產淨值出售，並於單一估值時間交易而不會有公開市場交易的日間流動性。視乎市況，上市類別的投資者可能因此較非上市類別的投資者有利或不利。
- 在市場受壓的情況，非上市類別投資者可按資產淨值贖回其單位，而上市類別投資者則不可以，彼等可能須按較大折讓的價格退出子基金。另一方面，上市類別投資者可於日間在二級市場賣出其單位，從而鎖定其狀況，非上市類別投資者則不可以及時這樣做，而須待日終才可鎖定其狀況。

#### **9. 跟蹤誤差風險**

- 子基金或會涉及跟蹤誤差風險，即其表現未必能準確追蹤相關指數的風險。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相關指數的表現。

## 10. 買賣風險

- 聯交所單位的交易價格受市場因素（例如單位的供求）影響。因此，這些單位的交易價格可能大幅高於 / 低於子基金的資產淨值。
- 由於投資者將支付某些費用（例如交易費和經紀費）以在香港聯交所買賣單位，因此投資者在購買聯交所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。

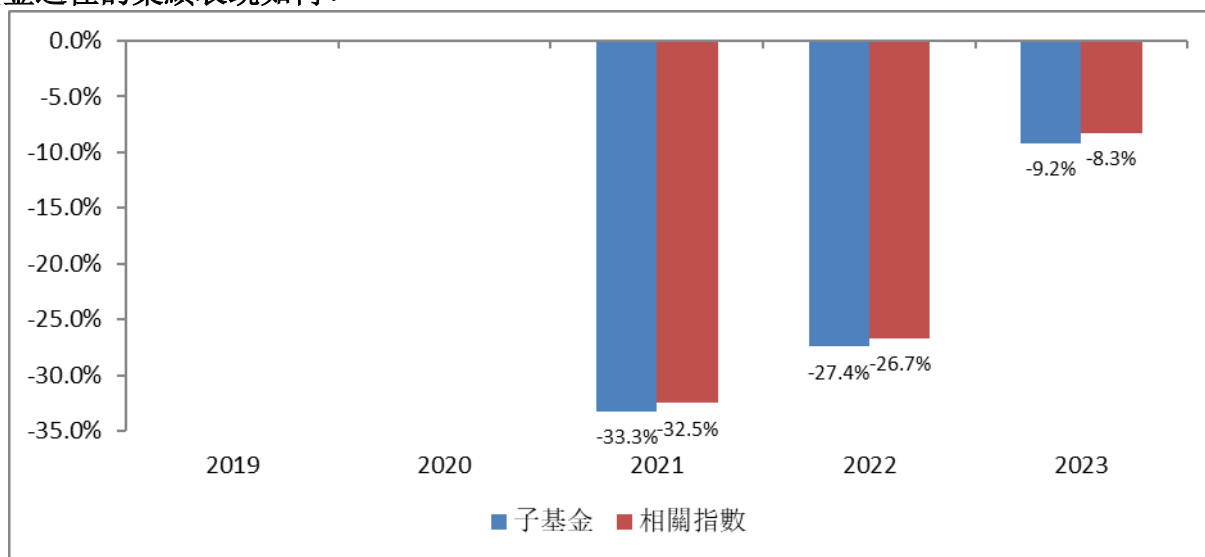
## 11. 提早終止風險

- 基金在若干情況下或會提早終止，例如相關指數不再可供作為基準或子基金的規模跌至 100 百萬港元以下。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。

## 12. 有關從資本中支付分派的風險

- 從資本中支付或實際上從資本中支付股息相當於退還或提取投資者的部分原有投資或歸屬於該原有投資的資本收益。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子基金的每單位資產淨值即時減少。

## 本基金過往的業績表現如何？



- 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，股息會滾存再作投資。
- 上述數據顯示基金總值在有關年內的升跌幅度。業績表現以港元計算，當中反映出基金的持續費用，但不包括於聯交所交易的費用。
- 如年內沒有顯示有關的業績表現，即代表當年沒有足夠數據用作提供業績表現之用。
- 基金發行日: 2020年8月28日

## 有否提供保證？

子基金並不提供任何保證。閣下未必能取回閣下的投資款項。

## 有甚麼費用及收費？

### 在聯交所買賣單位所招致的收費

費用	閣下所付金額
經紀費用	按市場費率 <sup>1</sup>
交易徵費	0.0027% <sup>2</sup>
會計及財務匯報局交易徵費	0.00015% <sup>3</sup>
交易費用	0.00565% <sup>4</sup>
印花稅	無

### 子基金就單位應持續支付的費用

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相關單位的資產淨值，並可能影響子基金的成交價，因而對閣下造成影響。

	<u>年率（佔單位資產淨值的百分比）</u>
管理費*	每年 0.99%
受託人費用 （包括應付予託管人的費用）	包括在管理費內
過戶處費用	包括在管理費內
表現費	無
行政費	無
其他持續支付的費用	請參閱本章程第二部分

\* 務請注意，某些費用可藉向單位持有人發給一個月的事先通知而增加至允許上限的金額。詳情請參閱章程第一部分「費用及收費」一節。

### 其他資料

基金經理將會在網站（<http://www.csopasset.com/tc/products/co-chst>（該網站未經證監會審閱））同時以中、英文發佈有關子基金的重要消息及資料，包括：

- 章程（經不時修訂及補充）；
- 最新的產品資料概要；
- 最新的年度及半年度財務報告（英文版）；
- 子基金作出的任何公告，包括有關子基金及相關指數的資料、暫停計算資產淨值、更改費用和收費、暫停及恢復單位發行、增設及贖回的通知；
- 有關子基金或會影響其投資者的重大變動，例如對子基金的銷售文件及組成文件之重大修改或增補的通知；
- 子基金在聯交所正常交易時間內接近實時的指示性每單位資產淨值（每 15 秒更新一次）；
- 子基金的最後資產淨值及子基金的最後每單位資產淨值；
- 子基金的完整投資組合（每日更新）；
- 最近 12 個月的股息組成（即從可分派收入淨額及資本中支付的相對金額）（亦可向基金經理索取）；
- 子基金的跟蹤誤差及偏離度；

<sup>1</sup> 經紀費用應由買方及賣方所用的中介人決定的貨幣支付。

<sup>2</sup> 交易徵費為單位成交價的 0.0027%，應由每名買方及賣方支付。

<sup>3</sup> 會計及財務匯報局交易徵費為單位成交價的 0.00015%，應由每名買方及賣方支付。

<sup>4</sup> 交易費用為單位成交價的 0.00565%，應由每名買方及賣方支付。

- 參與交易商及市場莊家的最新名單；及
- 向香港投資者發售的其他類別的過往業績表現資料；

有關上市類別單位：

- 增設申請或贖回申請於就每個交易日而言的交易期間由每個交易日上午 9 時正（香港時間）開始至每個交易日下午 3 時 30 分（香港時間）（以現金申請）或下午 4 時 30 分（香港時間）（以實物申請）的截止交易時間結束，並可由基金經理不時修改\*；及
- 二級市場投資者可於聯交所開市的任何時間，透過其證券經紀在聯交所買賣上市類別單位。投資者可按市價買入或出售上市類別單位。

估值時間約為適用的估值日（即每個交易日）下午 4 時 10 分（香港時間）。

\* 投資者應注意在相關交易日（T 日）交易時間內，即由交易日（T 日）上午 9 時正（香港時間）開始至下午 3 時 30 分（香港時間）（以現金申請），或下午 4 時 30 分（香港時間）（以實物申請），收到的對上市類別單位的增設與贖回申請，將按照於 T 日的估值時間決定的上市類別單位的單位資產淨值處理。例如：

- 於 T 日下午 3 時 30 分（香港時間）（以現金申請），或下午 4 時 30 分（香港時間）（以實物申請）前收到的對上市類別單位的增設與贖回申請，將按照於 T 日的估值時間決定的上市類別單位的單位資產淨值處理；
- 於 T 日下午 6 時（香港時間）收到的對上市類別單位的增設與贖回申請（即於該類別 T 日截止交易時間，T 日下午 3 時 30 分（香港時間）（以現金申請），或下午 4 時 30 分（香港時間）（以實物申請）之後），將按照於下一個交易日（T+1 日）的估值時間決定的上市類別單位的單位資產淨值處理。

## 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。