

重要事項：

投資者須注意，所有投資均涉及風險（包括可能會損失投資本金），基金股份價格可升亦可跌，過往表現並不可作為日後表現的指引。投資者在作出任何投資決定前，應詳細閱讀有關本公司之章程（包括子基金的產品資料概要及當中所載之風險因素之全文）。

香港聯合交易所有限公司（「聯交所」）、香港中央結算有限公司（「香港結算」）及證券及期貨事務監察委員會（「證監會」）對本文件之內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並明確表示不會就本文件全部或任何部分內容所產生或因依賴該等內容而引起的任何損失承擔任何責任。

證監會認可不等如對子基金作出推介或認許，亦不是對子基金的商業利弊或表現作出保證，更不代表子基金適合所有投資者，或認許子基金適合任何個別投資者或任何類別的投資者。

此乃重要文件，務請閣下即時垂注。閣下如對本文件之內容有任何疑問，應尋求獨立及專業的財務意見。



南方東英槓桿及反向系列 II

（根據香港《證券及期貨條例》（香港法例第 571 章）第 104 條
獲認可的香港傘子單位信託）
（「信託」）

南方東英納斯達克 100 指數每日槓桿(2x)產品

股份代號：7266

（「產品」）

公告 指數編算方法變更

南方東英資產管理有限公司 CSOP Asset Management Limited（「基金經理」）謹此通知南方東英納斯達克 100 指數每日槓桿(2x)產品（「產品」）的單位持有人，NASDAQ, Inc.（「指數提供者」）從 2024 年 6 月份之指數季度檢討實施對產品的相關指數納斯達克 100 指數（「指數」）的更改，並於 2024 年 6 月 24 日（「生效日期」）生效。

投資者在買賣產品的單位時應小心行事。除非另有釋義，否則所有術語應與產品章程內的含義相同。

指數編算方法變更

基金經理謹此通知產品的單位持有人，指數提供者從 2024 年 6 月之指數季度檢討更新指數的指數編算方法，檢討結果於 2024 年 6 月 24 日生效。需特別注意將進行以下變更：

	舊有指數編算方法	新指數編算方法
證券資格準則	倘證券發行人根據美國以外司法管轄區之法律成立，則該證券須擁有於美國獲認可期權市場上市之期權或合乎上市期權資格於美國獲認可期權市場買賣。	此期權相關的資格準則已被刪除。
	證券在前 3 個月的交易期內的最低日均成交量須至少為 200,000 股。	證券的三個月日均交易價值必須至少有 500 萬美元。
	沒有流通量資格標準。	證券必須有最低 10% 的自由流通量。
指數重組和重新調整的時間表	證券資格準則採用截止十月底為止的市場數據和十一月底的已發行總股份。	證券資格準則採用十一月最後一個交易日的市場數據及已發行總股份。

詳情（包括指數編算方法、最新指數資料及其他重要資訊），請參閱指數提供者的網站 https://indexes.nasdaqomx.com/docs/Methodology_NDX.pdf（此網站未經證監會審閱）。

對產品的影響

本公告所述之變更不會對現有投資者的權益造成重大損害。變更後產品的整體風險狀況也不會發生任何重大變更或增加。該變更將不會影響指數在證監會的單位信託及互惠基金守則項下要求的獲接納準則。本公告所述之變更不會影響產品的運作和投資策略及/或管理產品的方式。變更不會產生任何成本及/或費用。

一般事項

上述變更及相應的修訂將反映於產品經修訂的章程及產品資料概要，並將在可行的情況下盡快於基金經理的網站(www.csopasset.com)（此網站未經證監會審閱）及香港交易所的網站 (www.hkexnews.hk) 公佈。

閣下如對本公告的任何事宜有任何疑問或需要進一步資料，請於香港中環康樂廣場 8 號交易廣場二期 2801-2803 室聯絡基金經理或致電客戶服務熱線：(852) 3406 5688。

承董事會命
南方東英資產管理有限公司
行政總裁
丁晨

2024年7月2日

截至本公告日期，基金經理的董事會由七名董事組成，分別是周易先生、丁晨女士、張高波先生、楊小松先生、蔡忠評先生、柳志偉先生及朱運東先生