南方富時中國A50 ETF

股份代號：82822/2822

所有資料截至2017年3月31日

投資者應注意：投資涉及風險，包括可能會損失投資本金。投資者應詳細閱讀有關ETF的章程及產品概要（包括當中所載之產品特色及風險因素）。投資者不應僅憑本文件做出投資決定。投資者還應注意：

- 南方富時中國A50 ETF（「本基金」） 投資目標為提供緊貼富時中國A50指數（「相關指數」）表現的投資回報（扣除費用及開支前）。相關指數由在上海證券交易所或深圳證券交易所上市、中國總市 值最大的50家A股公司組成。投資者亦有可能損失部分或所有投資本金。
- 本基金是其中一隻首批直接投資於A股市場（本身為被限制進入的市場）並在中國境外發行的人民幣實物A股交易所買賣基金。由於本基金僅僅投資於中國 市場，故承受新興市場風險（例如是較高的經濟、政治、稅務、外匯、規管、波動性及流動性風險）和集中性風險。
- 由於本基金資產乃以人民幣計值，故已於港元櫃台買入單位的投資者或須承受貨幣兌換風險。
- 本基金的人民幣買賣單位的流動性及成交價或會受到人民幣在中國境外可提供的有限數量及外幣與人民幣之間的兌換限制所造成的不利影響。
- 投資於本基金會涉及中國稅務法律變動的相關風險。稅項撥備可能過多或不足以 應付實際稅項責任。撥備與實際稅項責任之間的任何不足數額，將從本基 金資產中扣除，而這將會對本基金的 資產淨值產生不利影響。
- 由於本基金的費用及開支、市場流 動性、回報的關聯性不完美以及其他因素，例 如於某些例外情況下，採用具代表性抽樣投資策略及投資集體投資計劃， 本基金的回報或會偏離相關指數的回報。
- 本基金單位於香港聯交所買賣，價格以二級市場的買賣因素釐定，這有可能導致 本基金單位的價格遠遠 偏離基金的資產淨值及基金單位的交易價格將可能 較每基金單位資產淨值大幅溢價/折讓。
- 基金經理可酌情從資本中作出派息 。從資本中作出派息或實際上從資本中作出派 息相當於從投資者原本 的投資中或從原本的投資 應佔的任何資本收益中收 回或提取部分金額。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令每單位資產淨值即時減少。

投資目標

此基金為一隻實物ETF，在提供於扣除費用及開支之前與富時中國A50 指數表現非常接近之投資回報。

基金信息

法律結構	香港單位信托
管理人	南方東英資產管理有限公司
上市交易所	香港聯交所 – 主板
投資策略	全面複製策略
基金規模	人民幣176.7億
已發行單位	1,714,000,000
基礎貨幣	人民幣
股份類別貨幣	人民幣，港幣
派息頻率[4]	每年
基金托管人	香港上海匯豐銀行有限公司
基金中國託管人	匯豐銀行（中國）有限公司
基金受托人及過戶處	匯豐機構信託服務（亞洲）有限公司

累積表現(%)[1]

櫃檯	1個月	6個月	1年	3年	上市至今[3]
人民幣	-0.41	7.71	11.72	68.81	58.73
指數[2]	-0.28	8.46	11.32	71.37	64.80

曆年表現(%)[1]

櫃檯	2012[3]	2013	2014	2015	2016	今年至今
人民幣	15.08	-12.44	65.69	-4.01	-4.82	4.06
指數[2]	17.40	-12.02	68.08	-5.04	-4.26	4.41

資料來源：彭博

股份類別信息

櫃檯	淨值	上市日期	ISIN代碼	交易所代碼	彭博代碼	每手交易數量	管理費	上次派息[5]
人民幣	10.31	2012年8月28日	HK0000112307	82822	82822 HK Equity	200個單位	每年0.99%	人民幣0.27
港幣	11.64	2012年11月8日	HK0000127412	2822	2822 HK Equity	200個單位	每年0.99%	人民幣0.27

註腳：

1. 基金表現以人民幣計價，按單位資產淨值計算，包括股息再投資。
2. 2015年2月27日之前，基金追踪富時中國A50指數（彭博代碼：XIN9I Index），該指數為全價指數。自2015年2月27日起，基金追踪富時中國A50淨總回報指數（彭博代碼：XINA50NC Index），該指數為淨總回報指數。
3. 自基金上市日2012年8月28日起計算。
4. 派息頻率可能由基金經理酌情變更。
5. 除淨日：2016年12月16日。

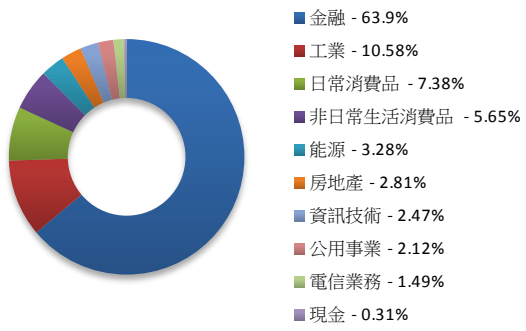
南方東英資產管理有限公司； 香港中環康樂廣場8號交易廣場二期2801-2803室
電話:(852) 3406-5688; 網址: www.csopasset.com; 電郵: investorservice@csopasset.com

南方富時中國A50 ETF

股份代號：82822/2822

所有資料截至2017年3月31日

行業配置



資料來源：彭博

前十大持倉

公司名稱	佔資產淨值(%)
中國平安	8.93
招商銀行	5.95
興業銀行	5.83
民生銀行	5.12
貴州茅台	4.58
浦發銀行	4.45
中信証券	3.28
交通銀行	3.27
農業銀行	3.09
美的集團	3.07

參與證券商

ABN AMRO Clearing Hong Kong Limited
Barclays Bank PLC
法國巴黎銀行全球託管行
中銀國際證券有限公司
中國銀河國際證券(香港)有限公司
中國國際金融香港證券有限公司
招商證券（香港）有限公司
聯昌證券有限公司
中信証券經紀(香港)有限公司
Citigroup Global Markets Asia Limited
Credit Suisse Securities (Hong Kong) Limited
德意志證券亞洲有限公司
安信國際證券(香港)有限公司
高盛(亞洲)證券有限公司
國泰君安證券(香港)有限公司
海通國際證券有限公司
J.P. Morgan Broking (Hong Kong) Limited
凱基證券(香港)有限公司
麥格理銀行有限公司
美林遠東有限公司
Morgan Stanley Hong Kong Securities Limited
野村國際(香港)有限公司
東英亞洲證券有限公司
法國興業證券(香港)有限公司
香港上海滙豐銀行有限公司
UBS Securities Hong Kong Limited
元大證券(香港)有限公司

市場莊家（人民幣買賣基金單位）

Commerz Securities Hong Kong Limited
IMC Asia Pacific Limited
Optiver Trading Hong Kong Limited
UBS Securities Hong Kong Limited
德意志證券亞洲有限公司
海通國際證券有限公司
Bluefin HK Limited
Credit Suisse Securities (Hong Kong) Limited
中信証券經紀(香港)有限公司
招商證券（香港）有限公司
花旗環球金融亞洲有限公司

市場莊家（港元買賣基金單位）

Commerz Securities Hong Kong Limited
IMC Asia Pacific Limited
Optiver Trading Hong Kong Limited
UBS Securities Hong Kong Limited
德意志證券亞洲有限公司
海通國際證券有限公司
Bluefin HK Limited
Credit Suisse Securities (Hong Kong) Limited
Eclipse Options (HK) Limited
Tibra Trading Hong Kong Limited
國泰君安證券（香港）有限公司
法國巴黎證券（亞洲）有限公司
躍鯤研發有限公司

有關滬港通的風險:

- 滬港通受額度限制所限。
- 子基金透過滬港通只可買賣若干於上交所上市的合資格股票。
- 預期聯交所及上交所擬保留權利在有需要時暫停北向及／或南向交易。
- 香港及上海市場的證券機制及法律體制大相逕庭。市場參與者可能需要持續應對因有關差異而引起的問題。
- 子基金根據滬港通以北向交易進行的投資將不受香港投資者賠償基金所保障。因此，子基金在透過該機制買賣中國A股時須面對所涉及經紀的違約風險。
- 滬港通屬開創性質的機制，而相關規定／規則亦未經考驗。概不確定有關規例將如何被應用，且有關規例可能不時變更。
- 請注意，以上列出的投資風險並非詳盡無遺，投資者應在作出任何投資決定前詳細閱讀本基金章程及產品資料概要。

富時指數免責聲明

- 富時中國A50指數（「指數」）中的所有權利均歸富時國際有限公司（「富時集團」）所有。「FTSE®」是倫敦證券交易所集團公司的商標，由富時集團根據授權使用。
- 南方富時中國A 50 ETF（「基金」）由南方東英資產管理有限公司獨家開發。該指數由富時集團或其代理機構計算。富時集團及其許可方與基金無關，也不對基金進行贊助、提供建議、推薦、認同或宣傳，也拒絕對任何人承擔因(a)使用、依賴指數或指數中的任何錯誤，或(b)投資於或經營基金導致的任何責任。富時集團不會對基金獲得的結果或該指數用於管理人所表述的有關目的作出任何明示或隱含聲明、預測、保證或陳述。
- 投資涉及風險。有關投資本基金所涉及的風險，詳情請參閱基金章程及產品資料概要。本公司對本基金的未來業績及資本值並無作出任何保證。過往的業績數據並不預示未來的業績表現。基金單位價值可升亦可跌。投資者應注意在若干情況下其贖回基金的權利可能遭暫時停止。我們建議投資者在進行投資前應索取及閱讀有關基金章程及產品資料概要。

本資料未經證券及期貨事務監察委員會審閱。

發行者：南方東英資產管理有限公司

南方東英資產管理有限公司; 香港中環康樂廣場8號交易廣場二期2801-2803室
電話:(852) 3406-5688; 網址: www.csopasset.com; 電郵: investorservice@csopasset.com