

重要提示：此乃重要文件，敬請即時細閱。如有疑問，請尋求專業意見。

香港聯合交易所有限公司（「**香港聯交所**」）、香港交易及結算所有限公司（「**港交所**」）、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**」）各自對本公告的內容概不負責，亦不對其準確性或完整性作出任何申述，並且明確地拒絕就由於或依賴本公告的全部或任何部分內容所引起的任何損失承擔任何責任。

基金經理對本公告所載資料於刊發日期的準確性承擔全部責任，並經一切合理查詢後，就其所深知及確信，於刊發日期，本公告內表達之一切意見乃經審慎周詳考慮方始作出。

證監會認可不等如對該計劃作出推介或認許，亦不是對該計劃的商業利弊或表現作出保證，更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。



CSOP ETF 系列*

(*此傘子基金包含合成交易所買賣基金)

(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)
(「本信託」)

南方東英 MSCI 港股通精選 ETF

股份代號：3432

(「子基金」)

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 MSCI 港股通精選 ETF (「**子基金**」) 的單位持有人，我們從 MSCI Inc. (「**指數提供者**」) 得悉子基金的相關指數 MSCI 港股通精選指數 (「**指數**」) 已作出數項變更。

投資者在買賣子基金的單位時應小心行事。除非另有釋義，否則所有術語應與子基金章程內的含義相同。

指數編算方法變更

基金經理謹此通知子基金的單位持有人，指數提供者已在 2024 年 8 月之指數檢討更新指數的指數編算方法。需特別注意將進行以下變更：

於季度指數審核加入根據業務類別相關性評分別除公司步驟

在季度指數審核期間，會採用額外篩選，依據業務類別相關性評分從篩選範圍中剔除公司。業務類別相關性評分大於 0% 的公司會從篩選範圍中被剔除。

將被剔除的 SIC 代碼詳情概述於 MSCI 港股通精選指數編算方法第 3.1 節。

於季度指數審核更改證券選擇步驟

在季度指數審核期間及經過業務類別相關性評分的篩選後，篩選範圍內的所有證券將根據證券的全數市值，按降序排列。前 27 隻證券將獲選。而排名 28 至 33 的任何現有成分股也將獲選，以達到 30 隻成分股。若 30 隻成分股未全，則根據排名選擇任何非現有成分股，以達到 30 隻成分股。

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://www.msci.com>（此網站未經證監會審閱）。

對子基金的影響

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。變更後子基金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子基金的運作和投資策略及/或管理子基金的方式。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子基金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9月3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