

重要事項：

香港交易及結算所有限公司（「**香港交易所**」）、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**」）對本公告的內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並表明不會就本公告全部或任何部分內容而產生或因依賴該等內容而引致的任何損失承擔任何責任。

證監會認可不代表證監會對本計劃作出推薦或認許，亦不代表其對本計劃的商業利弊或其表現作出保證。這不表示本計劃適合所有投資者或認許本計劃適合任何特定投資者或類別投資者。

此乃重要文件，務需閣下即時垂注。閣下如對本公告的內容有任何疑問，閣下應尋求專業意見。投資涉及風險，由於概不保證投資回報，故可能導致重大虧損。

基金經理就本公告所載資料之準確性承擔全部責任，並在作出一切合理查詢後確認已盡其所知所信，並無遺漏其他事實，以致其中任何陳述具有誤導成分。



南方東英槓桿及反向系列

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

南方東英恒生中國企業指數每日槓桿 (2x) 產品
股份代號：07288

南方東英恒生中國企業指數每日反向 (-1x) 產品
股份代號：07388
（統稱「各項產品」）

公告

恒生中國企業指數的更改

南方東英資產管理有限公司 CSOP Asset Management Limited（「**基金經理**」）謹此通知單位持有人有關南方東英槓桿及反向系列（「**本信託**」）的章程的若干修訂。修訂有關各項產品的指數，恒生中國企業指數（「**該指數**」）的更改。指數的更改將在2018年3月5日（「**生效日期**」）起生效。

投資者在買賣產品的單位時應小心行事。

恒生中國企業指數的更改

誠如各項產品的發行章程所披露，南方東英恒生中國企業指數每日反向 (-1x) 產品每日跟蹤該指數短倉的表現，南方東英恒生中國企業指數每日槓桿 (2x) 產品則每日跟蹤該指數表現的兩倍。作為本信託及各項產品的基金經理，本公司從該指數的指數提供者恒生指數有限公司（「恒生指數公司」）得知，自生效日期起，該指數將作出下文 A 部分所述的更改（統稱「指數更改」）。

A. 指數更改

根據恒生指數公司，於生效日期，紅籌股及民營企業（「P 股」）將合資格作為指數成份股獲納入該指數，共 10 隻紅籌股及 P 股將獲納入該指數，而該指數內的 H 股成份股數目將維持為 40 隻。因此，該指數的成份股總數將由 40 隻增加至 50 隻。

該 10 隻新增的紅籌股及 P 股成份股乃於該指數在 2017 年 12 月底進行的檢討中獲挑選，檢討結果已於 2018 年 2 月 6 日公佈。該 10 隻紅籌股及 P 股成份股將會在 12 個月期間內分五個階段獲納入該指數，每個階段將應用下表進一步闡述的比重納入因子及經調整的比重上限。預料在整個過渡期間，該 10 隻紅籌股及 P 股將保持不變。因此，預期對該指數的影響甚微。

階段	月份	比重納入因子	調整後比重上限
1	2018 年 3 月	0.2	2%
2	2018 年 6 月	0.4	4%
3	2018 年 9 月	0.6	6%
4	2018 年 12 月	0.8	8%
5	2019 年 3 月	1.0	10%

B. 各項產品更改

為尋求達致各項產品的相關投資目標，基金經理採用以期貨為基礎的模擬投資策略，透過直接投資於該指數的現貨月期貨合約（「國指期貨合約」），在符合發行章程所述的轉倉策略之下，爭取對該指數的所需持倉。

因指數更改，自生效日期起，各項產品所投資的國指期貨合約除受 H 股的表現所影響外，亦將受紅籌股及 P 股的表現所影響。

C. 對各項產品之影響

為免引起疑問，(i)除了各項產品在受 H 股的反向或槓桿表現（以適用者為準）影響以外，另受紅籌股及 P 股的反向或槓桿表現（以適用者為準）影響之外，各項產品之投資目標及政策將保持不變；(ii)指數更改將不會對各項產品構成重大變更；(iii)指數更改將不會影響該指數按證監會的單位信託及互惠基金守則的認受性；(iv)各項產品的正常運作將不會受到影響；(v)各項產品的整體風險狀況將不會有重大變更或增加；及(vi)指數更改並不會對單位持有人的利益造成實質性損害。

已修訂的章程

上述變更及相應的修訂將反映於產品的銷售文件。修訂的產品銷售文件將在生效日期或之前公佈於基金經理的網站(www.csopasset.com) 及香港交易所的網站 (www.hkex.com.hk)。

一般事項

除非另有釋義，否則所有術語應與各項產品的章程內的含義相同。

有關進一步資料

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，請聯絡基金經理的客戶服務熱線：(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

2018年2月15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、柳志偉先生及劉秀焰女士。