

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。



CSOP ETF 系列二

*（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）*

南方東英中國超短期債券 ETF
股份代號：83122（人民幣櫃台）及 03122（港幣櫃台）

公告

指數定價來源之變更、有關流通性風險管理及自動交換財務 賬戶資料的更新披露

南方東英資產管理有限公司 CSOP Asset Management Limited（「基金經理」）僅此通知 CSOP ETF 系列二（「本信託」）之子基金，南方東英中國超短期債券 ETF（「子基金」）之單位持有人，變更指數定價來源及修訂有關流通性風險管理及自動交換財務賬戶資料的更新披露，將於 2017 年 8 月 14 日起生效（「生效日期」）。

投資者在買賣本信託子基金的單位時應小心行事。

指數定價來源之變更

債券（包括中國政府及政策性銀行債券）一般會進行場外交易，因此並無單一市場價格。現如今就指數而言，花旗交易部所用的買盤價被採納作為首要來源，第三方定價來源（即 Thomson Reuters Pricing Service（「TRPS」），Thomson Reuters (Markets) LLC 的買盤定價）用於驗證。

為更好地管理指數定價的質量，於生效日期起 TRPS 的指數定價將作為的首要指數定價來源。

TRPS 是一個獨立的全球性評估定價來源，覆審超過 250 萬個固定收益證券、衍生品和銀行貸款。每天多次涵蓋所有主要的金融市場和價格可在。TRPS 定價旨在支持資產管理公司、託管銀行、共同基金、投資銀行、會計師事務所和金融研究提供商提供詳盡透明度的市場資訊及分析。TRPS 於提供估值及定價數據方面擁有逾 25 年經驗，其服務獲採納用於提供固定收益定價。TRPS 獨立於指數供應商、基金經理及受託人。有關 TRPS 之進一步資料，請瀏覽網站 www.thomsonreuters.com。

變更不會嚴重損害現有投資者的權利或利益，有關變更後子基金的整體風險亦不會有任何重大變更或增加。

有關流通性風險管理的更新披露

根據證監會於 2016 年 7 月 4 日發出的致證監會認可基金的管理公司有關流動性風險管理的通函，發行章程已予更新以包括管理人的流通性風險管理政策及程序的披露。

自動交換財務賬戶資料

《稅務（修訂）（第 3 號）條例》（「該條例」）已於 2016 年 6 月 30 日起生效。該條例為香港實施自動交換財務賬戶資料（「自動交換資料」）標準的法律框架。自動交換資料規定，香港的財務機構（「財務機構」）須收集與在財務機構持有財務賬戶的非香港稅務居民有關的若干所需資料，並將該等資料向香港稅務局（「稅務局」）申報以作自動交換資料用途。一般而言，資料將就屬與香港訂有有效主管當局協定（「主管當局協定」）的自動交換資料夥伴司法管轄區稅務居民的賬戶持有人而進行申報及自動交換；然而，子基金及／或其代理人可能進一步收集與其他司法管轄區的居民有關的資料。

子基金須遵循該條例的規定，這表示子基金及／或其代理人應收集並向稅務局提供與基金單位持有人及準投資者有關的所需資料。

有關進一步資料，請參閱章程(包括「自動交換財務賬戶資料」一節)。基金單位持有人及準投資者應就自動交換資料對其現時及擬於子基金作出的投資的行政及實質影響諮詢其本身的專業顧問。

已修訂的章程

上述變更、相應的修訂及其他更新將以附件形式反映於本子基金經修訂的章程。修訂的章程將在生效日期或之前於基金經理的網站(www.csopasset.com/etf) 及香港交易所的網站 (www.hkex.com.hk)公佈。

一般事項

除非另有釋義，否則所有術語應與子基金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

2017年8月11日

截至本公告日期，基金經理的董事會由七名董事組成，分別是丁晨女士、高良玉先生、張高波先生、狄高信先生、蔡忠評先生、李海鵬先生及吳增濤先生。