

2015 年 1 月 28 日

各位

管理会社名 中国南方アセット・マネジメント・リミテッド  
代表者名 最高経営責任者 丁晨  
(銘柄コード 1576)  
問合せ先 アンダーソン・毛利・友常法律事務所  
担当者 弁護士 平川 修  
(TEL 03-6888-1000)

### 参照指標の種別および配当支払月の変更について

弊社は、2015 年 1 月 27 日付けで、香港において、参照指標の種別および配当支払月の変更に関するプレスリリースを行いました。以下はその抄訳です。

南方 FTSE 中国 A 株 50 ETF（「本香港 ETF」）の参照指標である FTSE 中国 A50 インデックス（「参照指標」）の種別を、従来のプライス・リターン・インデックスからネット・トータル・リターン・インデックスに変更します。ネット・トータル・リターン・インデックスは、参照指標の構成銘柄から受け取る配当（源泉徴収税控除後）が当該構成銘柄の株式の追加取得に再投資されることを前提としています。また、本香港 ETF の配当支払月を 10 月から 12 月に変更します。

投資家におかれては、本香港 ETF 受益証券の売買を慎重に行っていただきますようお願いいたします。

#### 参照指標の種別の変更

本香港 ETF は、2012 年 8 月の設定以来、FTSE 中国 A50 プライス・リターン・インデックスを参照指標として採用してきました。プライス・リターン・インデックスには構成銘柄から受け取る配当の再投資は含まれません。

プライス・リターン・インデックスが構成銘柄の株価の変動のみを考慮するのに対し、ネット・トータル・リターン・インデックスでは、構成銘柄から受け取る配当（源泉徴収税控除後）が当該構成銘柄の株式の追加取得に再投資されることを前提としています。そのため、ネット・トータル・リターン・インデックスは一般的に、インデックスの投資リターンおよびパフォーマンスの実態をより正確に反映する指標であると考えられています。し

たがって、2015 年 2 月 27 日付けで本香港 ETF の参照指標の種別を、従来のプライス・リターン・インデックスからネット・トータル・リターン・インデックスに変更する予定です。本香港 ETF の資産運用会社である中国南方アセット・マネジメント・リミテッド（「資産運用会社」）は、参照指標の種別を変更することにより、現金の滞留が緩和されるだけでなく、トラッキングエラーも軽減されるものと考えます。また、参照指標の種別変更により、受益者の権利または利益が著しく損なわれることはなく、本香港 ETF の運営に悪影響が及ぶこともないものと考えます。

#### **配当支払月の変更**

2015 年 2 月 27 日付けで本香港 ETF の配当支払月を 10 月から 12 月に変更します。

**IMPORTANT:**

Hong Kong Exchanges and Clearing Limited (“**HKEx**”), The Stock Exchange of Hong Kong Limited (“**SEHK**”), Hong Kong Securities Clearing Company Limited (“**HKSCC**”) and the Securities and Futures Commission (“**SFC**”) take no responsibility for the contents of this Announcement, make no representation as to its accuracy or completeness and expressly disclaim any liability whatsoever for any loss howsoever arising from or in reliance upon the whole or any part of the contents of this Announcement.

SFC authorisation is not a recommendation or endorsement of a scheme nor does it guarantee the commercial merits of a scheme or its performance. It does not mean the scheme is suitable for all investors nor is it an endorsement of its suitability for any particular investor or class of investors.

**This document is important and requires your immediate attention. If you are in any doubt about the contents of this Announcement, you should seek professional advice. Investment involves risks which may result in significant loss as there is no guarantee on investment returns.**

The Manager accepts full responsibility for the accuracy of the information contained in this Announcement and confirms, having made all reasonable enquiries, that to the best of its knowledge and belief, there are no other facts the omission of which would make any statement misleading.



## **CSOP ETF SERIES**

*(a Hong Kong umbrella unit trust authorized under  
Section 104 of the Securities and Futures Ordinance (Cap. 571) of Hong Kong)*

### **CSOP FTSE China A50 ETF**

**Stock Codes: 82822 (RMB counter) and 02822 (HKD counter)**

## **ANNOUNCEMENT**

### **Changes to the type of Underlying Index and dividend payment month**

CSOP Asset Management Limited (the “**Manager**”) notifies unitholders of the amendments to the Prospectus of the CSOP ETF Series (the “**Trust**”) in relation to the change to the type of the underlying index of CSOP FTSE China A50 ETF (the “**Sub-fund**”). The type of the underlying index, FTSE China A50 Index (the “**Underlying Index**”) will be changed from price return index to net total return index, which assumes that dividends paid by the constituent securities of the index, net of any withholding taxed, are reinvested in additional shares of such index’s constituents. In addition, the dividend payment month of the Sub-fund will change from October to December. The changes made to the Prospectus shall take effect from 27 February 2015 (“the **Effective Date**”).

Investors should exercise caution in dealing with the units of the Sub-fund of the Trust.

### **Change to the type of the Underlying Index**

The Sub-fund has been using FTSE China A50 price return index as its underlying index since its inception in August 2012. Price return index does not include the reinvestment of dividends from the constituent securities of the index.

Price return index only considers price movements of the constituent securities of the index but the net total return index assumes that dividends paid by the constituent securities of the index, net of any withholding taxes, are reinvested in additional shares of such index's constituents. As such, an index's net total return is usually considered to be a more accurate measurement of the actual investment return and performance. Therefore, it is proposed that the type of the Underlying Index of the Sub-fund will change from price return index to net total return index from the Effective Date.

Index Code of the new Underlying Index is XINA50NC for Bloomberg and TRIXINA50N for Reuters respectively.

The Manager believes that the change to the type of the Underlying Index will not only reduce the cash dragging but also its tracking error of the Sub-fund. The Manager considers that the change made to the type of the Sub-fund's Underlying Index would not materially prejudice unitholders' rights or interests and does not anticipate adverse impact to the operation of the Sub-fund.

### **Change to dividend payment month**

From the Effective Date, the dividend payment month of the Sub-fund will change from October to December.

### **Updated Prospectus**

The Prospectus of the Sub-Fund will be updated by way of addendum to reflect the changes described above. The revised Prospectus and the revised Product Key Facts Statement will be uploaded on the Manager's website at [www.csopasset.com/etf](http://www.csopasset.com/etf) and the HKEx's website at [www.hkexnews.hk](http://www.hkexnews.hk) on the Effective Date.

### **General**

Unless otherwise defined, all capitalised terms shall have the same meaning as that in the Prospectus of the Sub-Fund.

### **For Further Information**

If you have any queries or require further information in relation to any aspect of this Announcement, please contact our Customer Service Hotline at (852) 3406 5688.

By Order of the Board  
**CSOP Asset Management Limited**  
Chief Executive Officer  
Ding Chen

27 January 2015

As of the date of this Announcement, the board of directors of the Manager comprises 7 Directors namely, Ms. Ding Chen, Mr. Gao Liangyu, Mr. Zhang Gaobo, Mr. Benoit Descourtieux, Mr. Yang Xiaosong, Mr. Cai Zhongping and Mr. Li Haipeng.