2803 HK
9803 HK

新資本投資者入境計劃
合資格基金 ^

Premia 中證財新中國基石經濟 ETF

2025年5月基金月報

所有數據截至 2025年5月30日

重要提示: 投資涉及風險，包括損失本金。投資者在決定是否適合投資Premia中證財新中國基石經濟ETF (「基金」)時，敬請參閱基金說明書及產品資料概要所載詳情，包括風險因素。投資者不應單靠本文件而作出投資決定。投資者應注意:

- 基金的投資目標是提供在扣除費用及開支前與中證財新銳聯基石經濟指數（「指數」）表現緊密相關的投資回報。
- **基本面多元因子加權指數風險:** 指數是一種新的基本面多元因子加權指數，其成份股根據某些量化投資因子進行選擇及加權。概不保證指數在任何時候都將跑贏市場。由於指數設計方法偏重某些特定的因子，可能會非有意地導致投資組合集中於某些特定行業。
- **互聯互通機制相關風險:** 基金將透過滬港通及深港通（統稱「互聯互通機制」）主要投資於A股，並受互聯互通機制相關風險限制。互聯互通機制的相關規則及規例有變更的可能性，該等變更可能具有潛在追溯效力。
- **人民幣貨幣及匯兌風險:** 基金的基礎貨幣為人民幣，任何單位股息亦以人民幣支付。人民幣現時不可自由兌換，並須受匯兌管制及限制規限。人民幣的任何貶值對投資者於基金的投資價值可能產生不利影響。以非人民幣為基礎貨幣的投資者須承受外匯風險。
- **中國市場風險:** 基金須承受中國市場風險。中國 A 股市場波動較大，可能存在潛在結算困難。該等波動可導致中國相關機構暫停A 股交易或實施影響單位交易／買賣並對基金的價值產生不利影響的其他措施。中國證券交易所通常有權暫停或限制相關交易所買賣的證券交易。
- **以資本或實際以資本撥付分派的的風險:** 管理人可酌情以資本或實際以資本撥付分派，意即退還或提取投資者原先投資或當中應佔任何資本收益的部分款項。任何這般撥付股息，可能會導致每單位資產淨值即時減少。
- **交易風險:** 基金單位於香港聯合交易所買賣。單位成交價乃受市場因素帶動，亦可能以對比基金資產淨值的較大溢價或折價買賣。
- **終止風險:** 若基金終止，投資者可能無法取回其投資及蒙受損失。

投資目標

本基金旨在提供在扣除費用及開支前與中證財新銳聯基石經濟指數表現緊密相關的投資回報。該基準指數根據企業的經濟規模、穩健財政及波動性，對上海或深圳證券交易所上市的中國公司進行篩選，最終選取約300隻股票為成份股。本基金為實物ETF，採用多元因子方法，透過互聯互通機制直接投資中國國內證券市場。

基金資料

管理人	睿亞資產管理有限公司
受託人	滙豐機構信託服務 (亞洲) 有限公司
上市交易所	香港交易所 - 主板
已發行單位	37,500,000.00
基金規模	3.05 億人民幣
基準指數	中證財新銳聯基石經濟指數
指數彭博代號	CSIR2927
管理費	每年 0.50%
基礎貨幣	人民幣

交易資料

上市日期	2017年10月24日
每手交易數量	500個單位 (港元櫃台) 500個單位 (美元櫃台)
資產淨值	8.1294 人民幣
股票代號	2803 HK (港元櫃台) 9803 HK (美元櫃台)
基金彭博代號	2803 HK Equity 9803 HK Equity
ISIN 代號	HK0000366176 (2803 HK) HK0000526241 (9803 HK)

累積表現 (%)

	年初至今	1個月	6個月	1年	自上市
基金	0.3%	3.9%	2.1%	9.1%	32.2%
指數*	0.6%	4.0%	2.5%	10.2%	44.7%

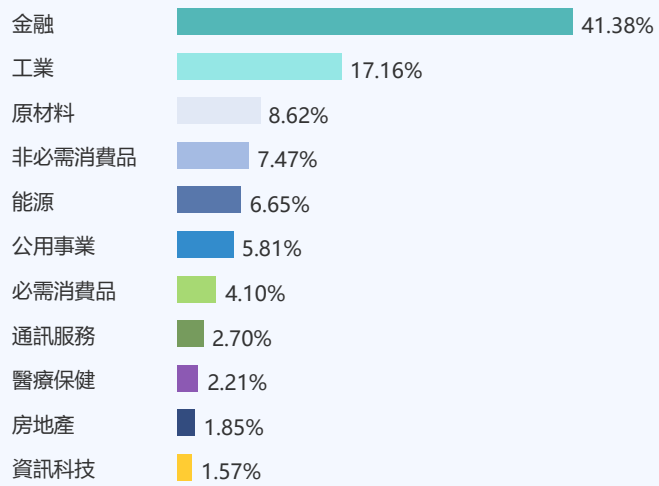
年度表現 (%)

	2015	2016	2017#	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024
基金	-	-	-0.1%	-21.0%	20.8%	6.1%	7.3%	-5.1%	6.2%	20.5%
指數*	-	-	-0.4%	-20.5%	22.3%	8.8%	8.6%	-4.1%	7.7%	21.7%

資料來源：彭博社、 睿亞資產
** 指數為中證財新銳聯基石經濟指數*
 # 從上市日至2017年底

過往業績資料並不代表將來表現。投資者未必能取回全部投資金額。業績表現以歷年末的資產淨值作為計算基礎，股息再作投資。此等數據顯示子基金價值在有關歷年內的升跌幅度。業績表現以人民幣計算，當中包括持續收費，但不包括閣下可能需繳交的香港聯交所交易成本。若未有列示過往業績，即表示該年度未有足夠數據以提供表現。基金成立日期: 2017年10月20日。

行業配置



數據來源: 睿亞資產

十大成份股

中國平安	3.73%
招商銀行	3.18%
工商銀行	1.98%
興業銀行	1.82%
美的集團	1.62%
農業銀行	1.54%
比亞迪	1.48%
貴州茅台	1.40%
江蘇銀行	1.15%
中國銀行	1.10%

數據來源: 睿亞資產

參與證券商

- ABN AMRO Clearing Hong Kong Limited
- Barclays Bank PLC
- 勤豐證券有限公司
- 國泰證券（香港）有限公司
- 建銀國際證券有限公司
- 招商證券（香港）有限公司
- 花旗環球金融亞洲有限公司
- 星展唯高達香港有限公司
- 廣發証券（香港）經紀有限公司
- 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
- 凱基證券亞洲有限公司
- 韓國投資證券亞洲有限公司
- Merrill Lynch Far East Limited
- 未來資產證券（香港）有限公司
- 元大證券（香港）有限公司

市場莊家

- Flow Traders Hong Kong Limited

* 如子基金的市場莊家名單有任何差異，請參閱香港聯合交易所網站。

關於睿亞資產

睿亞資產是一家於2016年由一群資深金融行業人士在香港創立的資產管理公司，致力開發ETF和智能貝塔等具低成本多元化優勢的投資工具，以幫助投資者更有效地創造長期價值。公司團隊來自於全球和亞太地區的行業領導者，對於ETF行業發展有豐富經驗和深刻體會。公司的理念是 - 集合團隊的專業實戰經驗，以及與世界頂尖專家合作的人脈優勢，為亞洲ETF市場注入新活力，打造國際級的ETF及智能貝塔產品以滿足投資者需求，從而更好地推動亞洲區的市場發展。欲瞭解詳情，請參閱www.premia-partners.com。

重要通告 基金追蹤其基礎指數的表現，而該指數並沒有將環境、社會和管治因素作為其主要投資重點。目前的披露是根據證監會的指引，並遵循管理人的氣候相關風險評估而作出。 管理人將就本披露的適用性和程度作定期評估。

免責聲明 本文件由睿亞資產管理有限公司所編制和發行。 Premia ETF 系列子基金獲香港證券及期貨事務監察委員會（「證監會」）認可。證監會的認可並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。本文件未經證監會審查，在任何管轄區中並不當成買賣任何證券或訂立任何其他交易的要約、推薦或招攬。對於在香港以外的司法管轄區的潛在投資者，請就認購基金的資格尋求專業意見。除非另有說明，所有資料均截至2025年5月30日。資料來源：彭博社和睿亞資產。以上資料僅供參考。**過往的業績資料並不預示未來的業績表現。**投資涉及風險，包括本金虧損的風險。對新興市場國家的投資可能涉及更高的風險，例如波動性增加和交易量下降，並可能比投資於發達國家的風險更大。在決定投資前，投資者應先閱讀基金說明書和產品資料概要，以瞭解詳情，其中包括風險因素。投資者可能無法收回全額本金。個別股票價格/表現不代表基金回報。投資回報和投資本金價值將上下波動，使得投資者將其出售或贖回時的股票價值可能大於或低於原始成本。如本文件的英文版與中文版內容不一致，則以英文版為準。

指數免責聲明 中證財新銳聯基石經濟指數（「指數」）由中證指數有限公司（「CSI」）計算。 CSI對指數或其任何數據的準確性、完整性、可靠性或其他方面不作任何聲明或保證。CSI對指數或其任何數據或任何構成指數的證券 (或其組合) 的使用或使用結果不作任何聲明。

^ 本基金為香港新資本投資者入境計劃的合資格集體投資計劃。詳情請參閱 香港證監會官方網頁。