

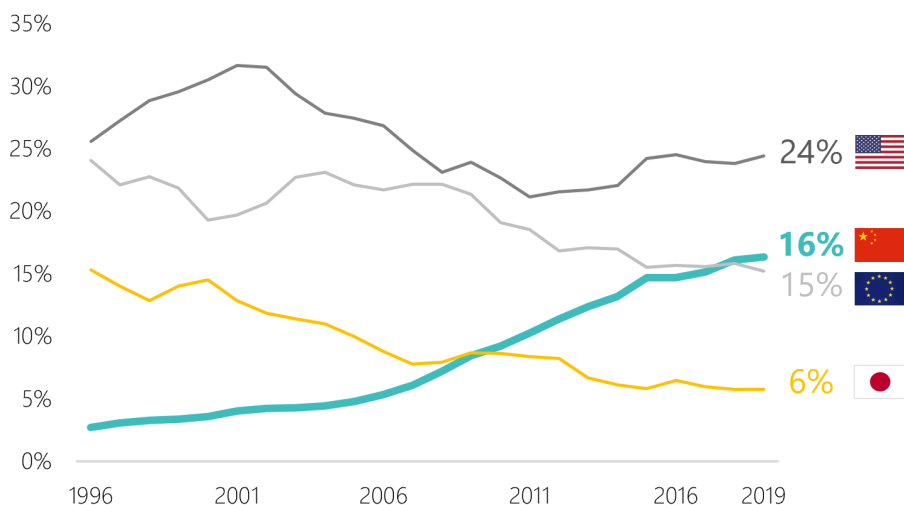
2803 HK 港元柜台

9803 HK 美元柜台

Premia 中证财新中国基石经济 ETF

中国强劲稳定的经济增长

世界 GDP 占比



资料来源：世界银行（现时美元；更新于2020年7月1日）

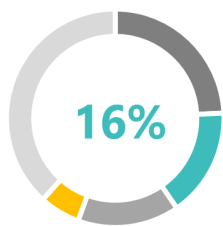
为何投资中国基石经济?

- 全球第二大经济体和第二大股票市场
- 全球十大经济体中增长最快的国家
- 国内消费推动经济增长
- 与全球大多数股票市场的相关性较低
- 强劲的政策维持国内股票市场稳定度
- 经济去杠杆及公司治理正持续改善

中国股市具庞大潜力

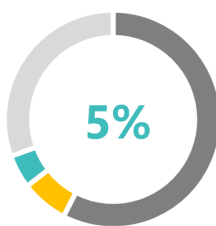
全球经济影响力

世界 GDP¹



全球资产配置

MSCI 世界指数²



巨幅落差

■ 美国 ■ 中国 ■ 欧元区 ■ 日本 ■ 其他

■ 美国 ■ 日本 ■ 中国 ■ 其它

资料来源：¹ 世界银行（截至2019年12月31日）；² MSCI（截至2020年6月30日）

资料来源：世界银行、彭博（2019年）

精准捕捉 – 300档具价值、优质、低波动和较小规模的企业

初始范围

2800+

中证全指指数

经济规模

880

最具经济规模的企业

- 总资产
- 账面值
- 总营业收入

财务健康

550

财务健康评分最高的企业

- 负债覆盖率
- 净营运资产率
- 应计项目
- 现金比率
- 净利润率

风险评分

300

风险评分最高的企业

- 过去一年波动率
- 过去一年市场贝塔
- 过去一年下行风险

再平衡调整



按市值加权

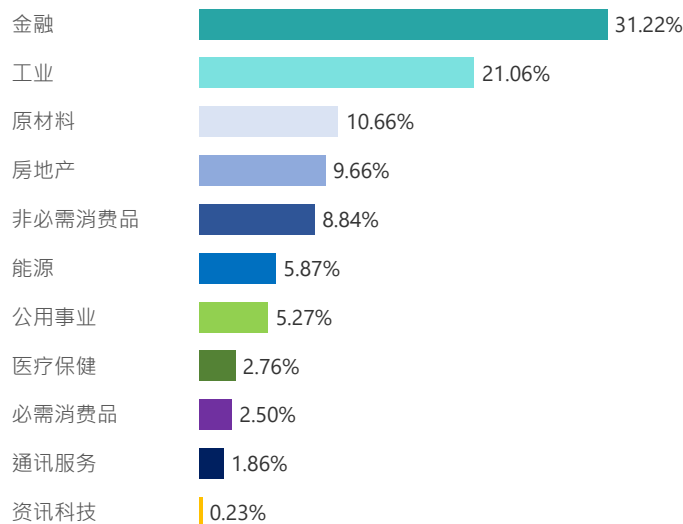
为何投资 Premia 中证财新中国基石经济 ETF?

- 捕捉贡献中国实体经济的高质素企业：广泛地投资于不同行业、降低集中性风险
- 聚焦于高质素、低波动及价值被低估的股份：与中证财新锐联合作、透过基本面多元因子策略进行筛选
- 具有成本效益：经常性开支上限定为每年0.50%

关于ETF

数据截至2021年01月29日

行业配置



前十大持仓

中国平安	6.97%
招商银行	4.26%
兴业银行	2.07%
工商银行	1.90%
美的集团	1.64%
平安银行	1.26%
万科A	1.22%
农业银行	1.06%
中远海控	1.02%
中国建筑	1.01%

基本资料

管理人	睿亚资产管理有限公司
受托人	汇丰机构信托服务(亚洲)有限公司
基金规模	4.65 亿人民币
基准指数	中证财新锐联基石经济指数
管理费	每年 0.50%
基础货币	人民币
上市日期	2017年10月24日

绩效表现



* 年化绩效自2005年6月30日至2021年01月29日；绩效按人民币计。资料来源：彭博（2005年6月30日至2021年01月29日；以2005年6月30日为基准日，基点为100）

指数	Premia 基石经济	沪深300	MSCI 中国A股	富时中国A50	MSCI 中国(境外)
年初至今	-2.45%	2.70%	2.42%	2.96%	5.74%
1年	9.59%	36.49%	35.98%	35.83%	35.84%
3年	-0.51%	10.15%	8.78%	11.02%	8.17%
5年	7.86%	15.15%	11.41%	18.72%	19.38%
10年	7.82%	7.93%	5.98%	10.17%	8.16%
自上市*	17.44%	14.21%	13.34%	13.18%	10.89%
波动率*	25.92%	26.63%	26.63%	26.69%	26.43%
夏普比率*	0.63	0.49	0.46	0.45	0.37

免责声明 本文件由睿亚资产管理有限公司所编制和发行。Premia ETF 系列子基金获香港证券及期货事务监察委员会（「证监会」）认可。证监会的认可并不等如对该计划作出推介或认许，亦不是对该计划的商业利弊或表现作出保证。本文件未经证监会审查，在任何管辖区中并不构成买卖任何证券或订立任何其他交易的要约、推荐或招揽。对于在香港以外的司法管辖区的潜在投资者，请就认购基金的资格寻求专业意见。除非另有说明，所有数据均截至2021年01月29日。数据来源：彭博社和睿亚资产。以上数据仅供参考。过往的业绩数据并不预示未来的业绩表现。投资涉及风险，包括本金亏损的风险。对新兴市场国家的投资可能涉及更高的风险，例如波动性增加和交易量下降，并可能比投资于发达国家的风险更大。在决定投资前，投资者应先阅读基金说明书和产品资料概要，以了解详情，其中包括风险因素。投资者可能无法收回全额本金。个别股票价格/表现不代表基金回报。投资回报和投资本金价值将上下波动，使得投资者将其出售或赎回时的股票价值可能大于或低于原始成本。如本文件的英文版与中文版内容不一致，则以英文版为准。

指数免责声明 中证财新锐联基石经济指数（「指数」）由中证指数有限公司（「CSI」）计算。CSI对指数或其任何数据的准确性、完整性、可靠性或其他方面不作任何声明或保证。CSI对指数或其任何数据或任何构成指数的证券（或其组合）的使用或使用结果不作任何声明。