

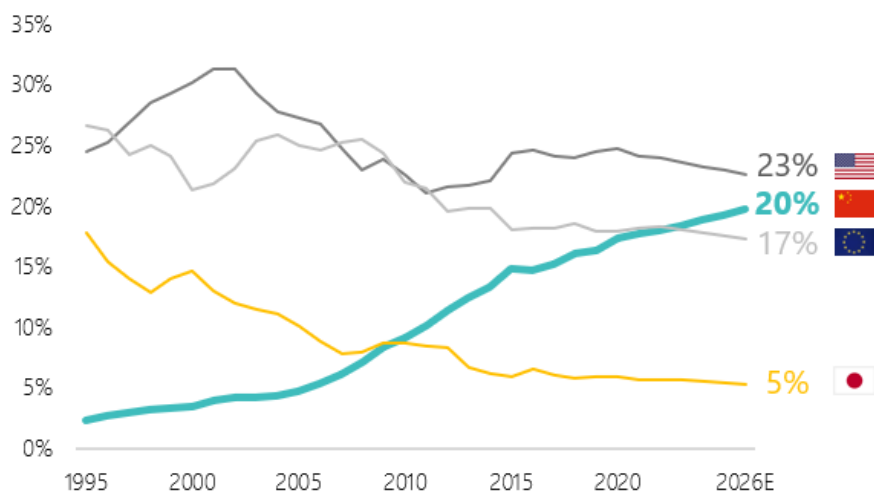
**2803 HK** 港元櫃台

**9803 HK** 美元櫃台

## Premia 中證財新中國基石經濟 ETF

### 中國強勁穩定的經濟增長

#### 世界 GDP 佔比



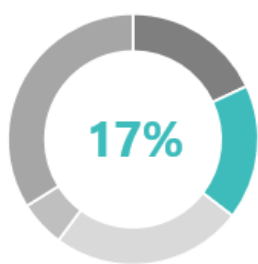
資料來源：國際貨幣基金組織、彭博（現時美元；2021至2026年數據由國際貨幣基金組織估計）；數據擷取於2021年4月

### 為何投資中國基石經濟?

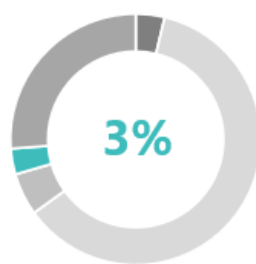
- 全球第二大經濟體和第二大股票市場
- 全球十大經濟體中增長最快的國家
- 國內消費推動經濟增長
- 與全球大多數股票市場的相關性較低
- 強勁的政府政策維持國內股票市場穩定度
- 經濟去槓桿及公司治理正持續改善

### 中國股市具龐大潛力

#### 全球經濟影響力 世界 GDP<sup>1</sup>



#### 全球資產配置 MSCI世界指數<sup>2</sup>



Mismatch

■ 歐洲 ■ 中國 ■ 美國 ■ 日本 ■ 其他

■ 英國 ■ 美國 ■ 日本 ■ 中國 ■ 其他

資料來源：<sup>1</sup>世界銀行, 2020年數據, <sup>2</sup>MSCI世界指數 · 數據截至2022年3月31日

資料來源：世界銀行、彭博（2019年）

### 精準捕捉 – 300檔具價值、優質、低波動和較小規模的企業

初始範圍

**2800+**

中證全指指數

經濟規模

**880**

最具經濟規模的企業

- 總資產
- 帳面值
- 總營運收入

財務健康

**550**

財務健康評分最高的企業

- 負債覆蓋率
- 淨營運資產率
- 應計項目
- 現金比率
- 淨利潤率

風險評分

**300**

風險評分最高的企業

- 過去一年波動率
- 過去一年市場貝塔
- 過去一年下行風險

每年調倉



按市值加權

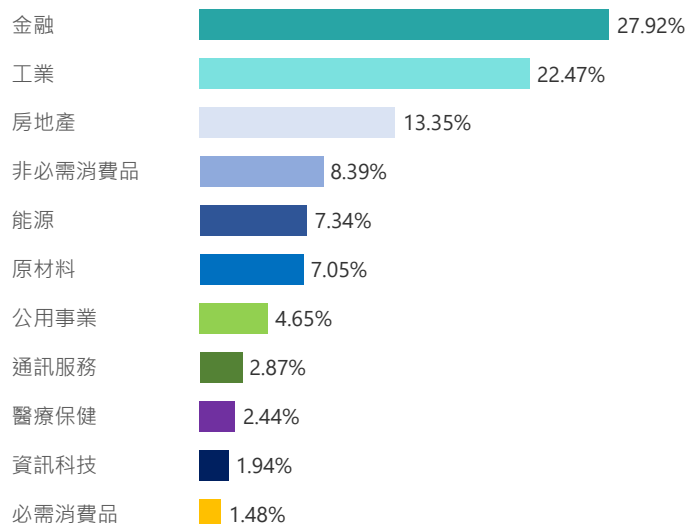
## 為何投資 Premia 中證財新中國基石經濟 ETF?

- 捕捉貢獻中國實體經濟的高質素企業：廣泛地投資於不同行業、降低集中性風險
- 聚焦於高質素、低波動及價值被低估的股份：與中證財新銳聯合作、透過基本面多元因子策略進行篩選
- 具有成本效益：經常性開支上限定為每年0.50%

## 關於 ETF

所有數據截至2022年4月29日

## 行業配置



## 前十大持倉

中國平安	4.32%
招商銀行	3.47%
工商銀行	1.92%
興業銀行	1.86%
中國建築	1.61%
農業銀行	1.38%
浙江建投	1.19%
交通銀行	1.16%
保利地產	1.10%
萬科A	1.06%

## 基本資料

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
基金規模	4.36 億人民幣
基準指數	中證財新銳聯基石經濟指數
管理費	每年 0.50%
基礎貨幣	人民幣
上市日期	2017年10月24日

## 指數績效表現



指數	Premia 基石經濟	滬深300	MSCI 中國A股	富時 中國A50	MSCI 中國(境外)
年初至今	-6.1%	-18.6%	-20.9%	-13.8%	-14.4%
1年	-0.9%	-20.2%	-19.1%	-20.4%	-34.9%
3年年化	2.9%	2.9%	4.2%	2.2%	-5.6%
5年年化	3.9%	5.3%	3.0%	8.2%	1.3%
10年年化	10.0%	6.6%	5.2%	8.1%	4.3%
自上市*	16.4%	11.3%	10.7%	10.3%	6.9%
波動率*	25.4%	26.2%	26.2%	26.4%	26.7%
夏普比率*	0.60	0.39	0.37	0.35	0.22

\* 年化績效自2005年6月30日至2022年4月29日；績效按人民幣計。資料來源：彭博（2005年6月30日至2022年4月29日；以2005年6月30日為基準日，基點為100）

**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2022年4月29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，以了解詳情，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。