

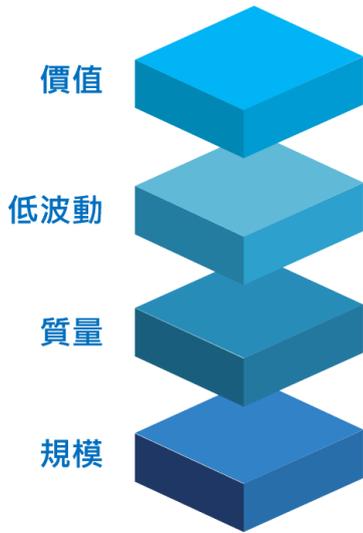
2803 HK 港元櫃台

9803 HK 美元櫃台

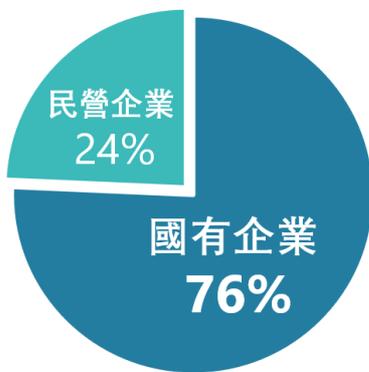
# Premia 中證財新中國基石經濟 ETF

新資本投資者入境計劃  
合資格基金\*

以中國市場研究為本的多元因子策略 受惠於國家國企改革



中國國企改革及  
價值重估的受益者

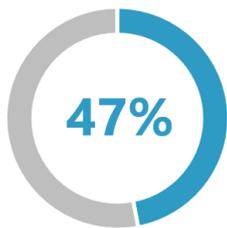


資料來源: CSI, 彭博, 睿亞資產, 2024年6月28日

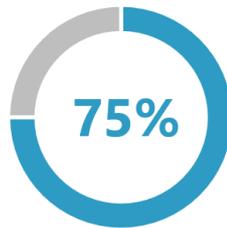
## 基本面穩健的經濟基石

基本面穩健的企業提供堅實可靠的表現  
不足5%的中國A股上市公司佔整個市場約一半收入及3/4營利

A股市場總收入佔比



A股市場總營利佔比



中國A股市場包括於深圳交易所及上海交易所掛牌的A股股票  
資料來源: CSI, 彭博, 睿亞資產, 2024年7月2日

## 為何投資 中國基石經濟?

- 透過價值、質量、低波動和規模等多元因子策略，精準捕捉基本面穩健推動中國基石經濟的優質企業
- 配合政策發展方向的資產配置 — 國企投資比例較高，讓投資者同時受惠於國企改革及價值重估等政策紅利
- 與大多數全球股票市場的相關性較低
- 著重政策重點支持行業及龍頭企業，加上低波動因子，相對整體市場尤其市場波動時期表現傾向穩定

\*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](#)。  
資料來源: 睿亞資產, 2023年

## 精準捕捉 – 300檔具價值、優質、低波動和較小規模的企業



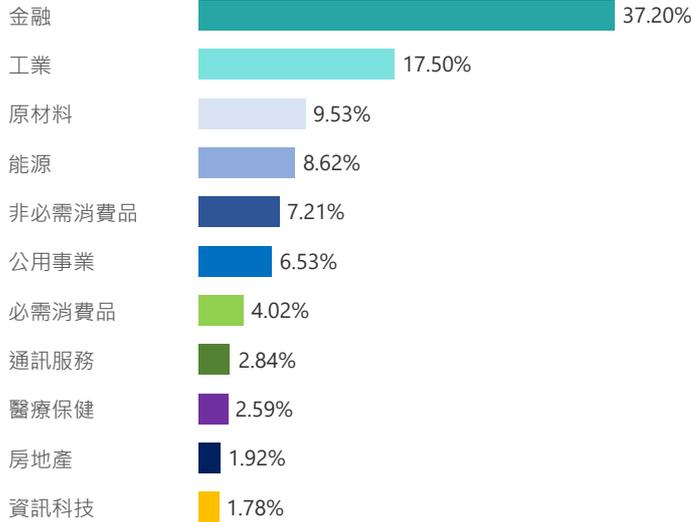
## 為何投資 Premia 中證財新中國基石經濟 ETF?

- 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2024年8月30日

## 行業配置



## 前十大持倉

中國平安	3.63%
招商銀行	2.77%
工商銀行	1.97%
貴州茅台	1.63%
興業銀行	1.56%
美的集團	1.55%
農業銀行	1.48%
交通銀行	1.38%
比亞迪	1.24%
中國石化	1.21%

## 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	3.64 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



\* 年化績效自2005年6月30日至2024年8月30日；績效按人民幣計。資料來源：彭博（2005年6月30日至2024年8月30日；以2005年6月30日為基準日，基點為100）

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	4.8%	-0.7%	-4.3%	5.4%	4.3%
1年	0.1%	-9.3%	-11.4%	-3.6%	-5.0%
3年年化	4.1%	-9.4%	-11.2%	-4.5%	-10.8%
5年年化	6.1%	-0.4%	-0.1%	-0.0%	-3.6%
10年年化	10.2%	5.8%	3.7%	8.0%	2.0%
自上市*	15.1%	9.2%	8.5%	8.7%	5.7%
波動率*	24.3%	25.1%	25.1%	25.3%	26.5%
夏普比率*	0.56	0.31	0.28	0.28	0.16

**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及發行。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構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2024年8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。