南方東英國指備兌認購期權主動型ETF

股份代號：2802

所有資料截至 2026年8月31日

投資者應注意:
南方東英國指備兌認購期權主動型ETF

- 南方東英國指備兌認購期權主動型ETF（「子基金」）是CSOP ETF系列*（*此傘子基金包含合成交易所買賣基金）（「本信託」）的一個子基金，而本信託是根據香港法例成立的傘子單位信託。子基金乃根據《單位信託及互惠基金守則》（「《守則》」）第8.10章獲認可的主動型管理交易所買賣基金。
- 子基金每次沽出國指認購期權均會收取期權金。倘子基金所持有的參考指數相關證券價值下跌，子基金就沽出國指認購期權收取的期權金或可在一定程度上減少有關損失。
- 採用備兌認購期權策略的缺點是子基金從參考指數水平上升獲利的潛力有限，以所沽出的國指認購期權的行使價為限，再加上所收取的期權金。
- 子基金採用備兌認購期權策略，當中涉及沽出參考指數的認購期權。備兌認購期權策略雖能提供一定程度的下行保障，但潛在升幅亦受限制。儘管此策略具備下行保障，如國指水平大幅下跌，仍有可能遭受重大甚至全數損失。國指認購期權的市值可能受一系列因素影響，包括但不限於供需情況、利率及參考指數的現行市價（相對於國指認購期權行使價）、參考指數的實際或預期波動以及直至到期日的餘下時間。
- 子基金將會買入國指股票、國指期貨及國指ETF的相關長倉，而作為以相關長倉進行備兌的國指認購期權的賣方，子基金將會繼續承擔參考指數市值下跌的風險。倘國指認購期權到期，且參考指數市值於期權期間下跌，則子基金自沽出國指認購期權收取的期權金可能不足以抵銷所變現的虧損。
- 使用期貨合約涉及的風險可能高於直接投資於證券及其他較傳統的資產的風險。儘管國指期貨市場的發展相對成熟，子基金面臨其未必可終止或出售持倉的潛在風險。在子基金有意終止或出售持倉時，子基金的有關持倉的流通二級市場未必會一直存在。
- 子基金採用主動型管理的投資策略。由於基金經理的投資選擇，及／或實施的程序可能導致子基金表現低於直接投資於參考指數的成份股本證券，子基金可能無法達成其目標。
- 子基金因投資單一地區或國家（中國內地）而承受集中風險。
- 單位在聯交所的交易價格，由單位供求等市場因素帶動。因此，這些單位的交易價格可能大幅高於／低於子基金的資產淨值。
- 從資本中支付股息或實際從資本中支付股息，相當於退還或提取投資者部分原有投資額或歸屬於該原有投資額的資本收益。任何涉及從子基金的資本或實際從資本中支付股息的該等分派，可導致子基金的每單位資產淨值即時減少。

請注意，以上列出的投資風險並非詳盡無遺，投資者應在作出任何投資決定前詳細閱讀相關基金章程及產品資料概要。投資涉及風險，投資產品的價值可升亦可跌，過往的業績資料並不預示未來的業績表現。投資者不應僅依賴本資料作出投資決定。

投資目標

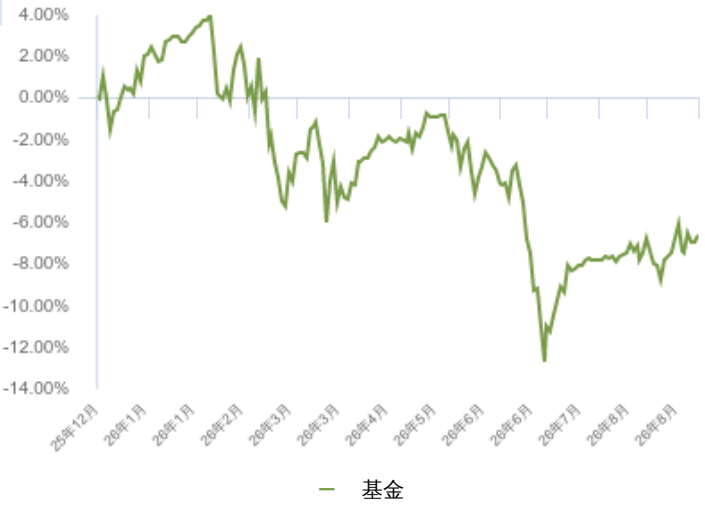
南方東英國指備兌認購期權主動型ETF（「子基金」）的投資目標是透過備兌認購期權策略產生收入、維持資本增值潛力，同時減輕部分下行風險。請注意，備兌認購期權策略亦會限制潛在上行空間。

累積表現(%)[1]

	1個月	6個月	1年	3年	成立至今
基金	0.92	-4.84	-	-	-6.59

曆年表現(%)[1]

	今年至今
基金	-7.32



數據從基金成立日截至 2026年8月31日
資料來源: 南方東英

基金信息

法律結構	香港單位信託
管理人	南方東英資產管理有限公司
基金總規模	港幣 92.68億
淨值	7.07
已發行單位	1,310,000,000
基礎貨幣	港幣
派息頻率 [3]	每月
基金托管人	香港上海滙豐銀行有限公司
基金受託人及登記處	滙豐機構信託服務（亞洲）有限公司

股份類別信息

交易貨幣	ISIN代碼	代碼	彭博代碼	每手交易數量	管理費[2]	上次派息[3]	除息日
港幣	HK0001226486	2802	2802 HK EQUITY	100	每年0.99%	港幣 0.15	2026年8月31日

南方東英資產管理有限公司; 香港中環康樂廣場8號交易廣場二期2801-2803室
電話:(852) 3406-5688; 網址: www.csopasset.com; 電郵: investorservice@csopasset.com

南方東英國指備兌認購期權主動型ETF

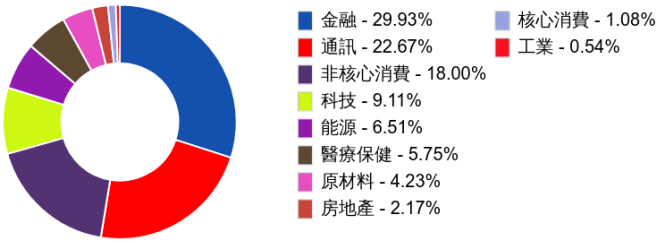
股份代號：2802

所有資料截至 2026年8月31日

前十大持倉

公司名稱	佔資產淨值(%)
建設銀行	7.71
騰訊控股	7.16
阿里巴巴	6.64
工商銀行	5.26
小米集團	4.23
中國移動	4.16
美團－W	3.70
中國銀行	3.54
中國海洋石油有限公司	3.33
中國平安	3.20

行業配置



資料來源: 彭博

免責聲明:
投資涉及風險，基金價格可升可跌，包括可能會損失投資本金。所呈列的往績資料並不表示將來亦會有類似的業績。投資者應仔細閱讀有關基金的銷售文件及產品資料概要，以獲取進一步資料，包括當中所載之產品特色及風險因素。投資者不應僅憑本文件做出投資決定。本文件所述的南方東英資產管理有限公司（「南方東英」）之投資產品得到香港證券及期貨事務監察委員會（「證監會」）認可。有關認可並不意味著獲得證監會官方推介。本文件僅供一般參考。在任何情況下，本文件並不構成對未來事件的預估、研究或投資建議，也不應被明示或暗示地解釋為購買、出售或銷售任何證券、基金或金融產品或進行任何投資或交易之任何類型的意見、要約、招攬要約、邀請、廣告、誘因、推薦、建議、遊說、陳述或承諾。南方東英對本文件概不負責，並表明不會就因本文件全部或任何部分內容而產生或因依賴該等內容而引致的任何損失承擔任何責任。本文件並不具法律約束力。如欲獲取投資之意見，請諮詢閣下的專業法律，稅務和財務顧問。本文件不適用於禁止其分發或發送的司法管轄區。產品僅在可以合法提供的司法管轄區內提供。本文件並未經證監會審核。
發行人：南方東英資產管理有限公司

註腳:

1. 產品表現根據基金單位資產淨值總回報以港幣 計算，包括股息再投資。
2. 請訪問南方東英網站和參閱有關基金銷售文件以獲取詳細信息。
3. 派息全額（如有）可能由基金經理酌情決定。請參閱南方東英網站及關於分派股息通告以了解派息記錄。

南方東英資產管理有限公司; 香港中環康樂廣場8號交易廣場二期2801-2803室
電話:(852) 3406-5688; 網址: www.csopasset.com; 電郵: investorservice@csopasset.com