

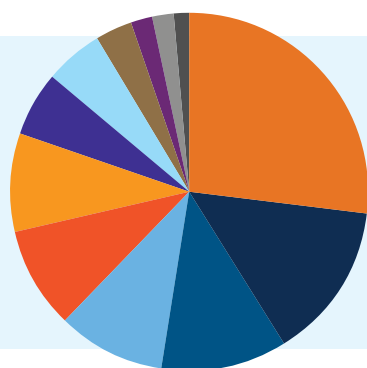
Indice CSI 300

Cet indice fait l'objet d'un suivi par QCH - FINB Actions chinoises de type A CSI 300 Mackenzie

Aperçu de l'indice

- Indice pondéré selon la valeur au marché fondé sur des règles pour offrir une exposition à 300 titres ayant la plus grande capitalisation boursière et la plus grande liquidité de tout l'univers des actions de type A de sociétés cotées en Chine.
- Lancé le 8 avril 2005, l'indice vise à mesurer la performance globale des actions de type A négociées à la bourse de Shanghai et à la bourse de Shenzhen.
- En fonction du principe de stabilité et de suivi dynamique, les composantes de l'indice CSI 300 sont passées en revue tous les six mois. L'indice CSI 300 est révisé les dix derniers jours des mois de mai et novembre de chaque année.

Caractéristiques de l'indice



Composition par secteur

27,1 %	Services financiers	5,9 %	Matériaux
14,2 %	Consommation courante	5,2 %	Autre
11,2 %	Technologie de l'information	3,4 %	Immobilier
9,9 %	Produits industriels	2,1 %	Services de Communication
9,1 %	Soins de santé	1,8 %	Services publics
8,8 %	Consommation discrétionnaire	1,3 %	Espèces et quasi-espèces

Ratio cours/bénéfice :

15,68x

Ratio cours/valeur

comptable : 1,85x

Rendement de la

distribution : 0,71 %

Source: Données du FNB QCH utilisées comme approximation; Mackenzie, au 31 juillet 2020

Règles d'inclusion

Admissibilité du pays

- Comprend 300 actions avec la plus grande capitalisation boursière et la plus grande liquidité de tout l'univers des sociétés cotées en Chine dont les actions sont de type A.

Critères d'inclusion

- L'univers de l'indice CSI 300 comprend toutes les actions de type A cotées à la bourse de Shanghai et à la bourse de Shenzhen qui remplissent les conditions suivantes :
 - Actions non-ChiNext : l'action est cotée à la bourse depuis plus de trois mois, à moins que la moyenne quotidienne de la valeur marchande totale d'une action depuis qu'elle a été cotée pour la première fois soit classée parmi les 30 premières de toutes les actions A (actions non-ChiNext);
 - Actions ChiNext : l'action est cotée à la bourse depuis plus de trois ans.
- Le calcul de l'indice CSI300 utilise une méthode pondérée par catégorie en fonction de laquelle CSI accordera un certain facteur d'inclusion au total des actions de type A de la catégorie actions en fonction du pourcentage d'actions à fluctuations libres dans les actions de type A de la composante afin d'assurer la stabilité de l'indice.



Règles d'inclusion

Capitalisation boursière en flottement libre

Pour les actions clairement annoncées comme restreintes par les sociétés cotées et les actions qui entrent dans les quatre types d'actions suivants :

- Les participations à long terme par les fondateurs, leurs familles et les cadres supérieurs, etc.
- Les actions détenues par l'État
- Les participations stratégiques
- Les régimes d'actionnariat des employés

Si la participation d'un actionnaire ou de plusieurs actionnaires agissant de concert est supérieure ou égale à 5 %, ces actions sont considérées comme des actions non flottantes.

Source : Solactive

Règles de rééquilibrage

Zone tampon

L'indice CSI 300 adopte une zone tampon pour réduire le roulement de l'ajustement de l'indice. Les nouvelles actions candidates classées parmi les 240 premières seront ajoutées en priorité à l'indice et les anciennes actions classées parmi les 360 premières seront conservées en priorité dans l'indice.

Valeur quotidienne moyenne et volume négocié

Le calcul est effectué de la valeur moyenne quotidienne des échanges et de la valeur moyenne quotidienne totale du marché au cours de l'année la plus récente pour les actions de l'univers de l'indice, ou dans le cas d'une nouvelle émission, le calcul est effectué depuis le 4^e jour de négociation après l'inscription.

- Les actions sont classées par ordre décroissant selon les cours en bourse moyens quotidiens de l'année la plus récente et les 50 % des actions dans la partie inférieure du classement sont retirés.
- Les actions restantes sont classées par ordre décroissant selon leurs valeurs marchandes moyennes quotidiennes de l'année la plus récente, et celles qui se classent parmi les 300 premières sont sélectionnées comme composantes de l'indice.

Source : Solactive

Tarification et questions connexes

Actions de société

- Dividende détaché : Pour l'indice CSI 300, aucun indice n'est ajusté en cas de dividende détaché (versement de dividendes), et sa chute naturelle ne doit pas être perturbée. L'indice de rendement total CSI 300 et l'indice de rendement total net CSI sont ajustés en fonction du cours de référence ex-dividendes avant la date ex-dividende.
- Droit détaché : En cas d'émission de primes, d'émissions de droits, de la division et de la consolidation des actions, l'indice est ajusté la veille de l'émission. Le calcul de la capitalisation boursière ajustée est fondé sur les nouvelles actions et les nouveaux cours.
- En cas de variation globale du total des actions des composantes en raison d'autres opérations sur titre par la société (p. ex., offre secondaire, conversion de créances en prises de participation et exercice de bons de souscription) qui atteint ou dépasse 5 %, l'indice est soumis à un ajustement temporaire et doit être ajusté avant la modification du capital des composantes de l'indice.
- Fusions, scissions, acquisitions et restructurations de sociétés non incluses dans l'indice : si la capitalisation boursière totale de la nouvelle société qui en résulte se classe parmi les dix premières du marché global en raison des opérations susmentionnées, des règles d'entrée rapide sont appliquées. Autrement, ces événements seront pris en compte ensemble dans l'ajustement régulier de l'indice.



Tarification et questions connexes

Premiers appels publics à l'épargne (PAPE)

Les exigences de négociabilité des sociétés dont la date du premier appel public à l'épargne tombe dans la période de six mois précédant le jour de sélection sont modifiées comme suit :

- Les nouvelles composantes de l'indice doivent avoir une valeur moyenne quotidienne négociée d'au moins 1 000 000 \$ US pendant la période précédente d'un mois.
- Les nouvelles composantes de l'indice doivent avoir un volume d'échange d'au moins 100 000 actions pendant la période précédente d'un mois.
- Les nouvelles composantes de l'indice doivent avoir un pourcentage de fluctuations libres d'au moins 10 %. Si la capitalisation boursière à fluctuations libres d'un titre est d'au moins 1 000 000 000 \$ US pour les nouvelles composantes de l'indice, l'exigence de pourcentage de fluctuations libres n'est pas prise en compte.
- Les nouvelles composantes de l'indice ne doivent pas avoir de jours pendant lesquels elles n'ont pas été négociées, soit depuis la date du PAPE, soit au cours de la période de trois mois précédente, selon la période la plus courte.
- Les nouvelles composantes de l'indice doivent avoir un historique de négociation d'au moins 20 jours ouvrables.

Source et fréquence

- L'indice est calculé et distribué une fois par jour ouvrable.

Moment

- L'indice est calculé toutes les 5 secondes jusqu'à la clôture de la séance.
- Si le dernier jour ouvrable est un jour férié, les prix du jour ouvrable précédent sont utilisés.

Source : Solactive

Les placements dans les fonds négociés en bourse (FNB) peuvent donner lieu à des commissions, des frais de gestion et d'autres frais. Veuillez lire le prospectus avant d'investir. Les FNB ne sont pas garantis, leur valeur varie fréquemment, et leur rendement antérieur peut ne pas se reproduire. Le contenu de cette présentation (y compris les faits, les perspectives, les opinions, les recommandations, les descriptions de produits ou de titres, ou les références à des produits ou à des titres) ne doit pas être pris ni être interprété comme un conseil en matière de placement, ni comme une offre de vendre ou une sollicitation d'offre d'achat, ou une promotion, recommandation ou commandite de toute entité ou de tout titre cité. Bien que nous nous efforcions d'en assurer l'exactitude et l'exhaustivité, nous n'assumons aucune responsabilité quant à son utilisation.

Tous les droits dans l'indice CSI 300 (« indice ») sont détenus par la China Securities Index Company (« CSI »). « CSI 300® » est une marque déposée de CSI. CSI n'offre aucune garantie, expresse ou implicite, quant à l'exactitude ou l'exhaustivité des données relatives à l'indice. CSI n'est responsable envers personne d'une quelconque erreur (due à de la négligence ou autre), et n'a aucunement l'obligation de signaler les erreurs dans l'indice à quiconque. Le Fonds basé sur l'indice n'est en aucun cas commandité, approuvé, vendu ou promu par CSI et CSI n'a aucune responsabilité à cet égard.