
重要资料：请务必仔细阅读本公告。如投资者对本公告的内容有任何疑问，应寻求独立专业意见。

恒生精选基金系列 - 恒生中国企业指数基金

关于更新招募说明书及产品资料概要的公告

自2018年9月14日起，恒生中国企业指数基金（“本基金”）的《恒生精选基金系列-恒生中国企业指数基金招募说明书》（“《招募说明书》”）及《恒生中国企业指数基金产品资料概要》（“《产品资料概要》”）作出修订。

一、《招募说明书》的修订

1. 内地销售规模

在《招募说明书》之《关于恒生精选基金系列-恒生中国企业指数基金在内地销售的补充说明书》第二部分“香港互认基金的特别说明”第1条“满足互认安排的资格条件及未能满足条件时的相关安排”下第(5)点“基金的成立年限、规模、投资方向和销售规模符合《香港互认基金管理暂行规定》第四条第(五)项要求”之第iv项中明确，若在某个内地工作日接收到的申购申请可能导致超过50%的上限，内地代理人亦将有权拒绝超出部分的申购申请。

2. 相关税收安排

在《招募说明书》之《关于恒生精选基金系列-恒生中国企业指数基金在内地销售的补充说明书》第二部分“香港互认基金的特别说明”第2条“相关税收安排”下，进一步明确内地投资者投资于本基金的税项。

3. 内地代理人的职责

在《招募说明书》之《关于恒生精选基金系列-恒生中国企业指数基金在内地销售的补充说明书》第二部分“香港互认基金的特别说明”第4条“适用于内地投资者的交易及结算程序”下第(1)点“基金管理人的内地代理人”中，根据基金管理人与内地代理人于2016年2月25日签署的代理协议版本，进一步补充、明确了内地代理人的职责。

4. 申购、赎回的计算公式

在《招募说明书》之《关于恒生精选基金系列-恒生中国企业指数基金在内地销售的补充说明书》第二部分“香港互认基金的特别说明”第4条“适用于内地投资者的交易及结算程序”下第(8)点“基金的申购、赎回与转换的规则”中补充“v. 申购份额的计算”及“vi. 赎回金额的计算”，列出申购、赎回的计算公式并举例说明。

5. 申购款和赎回款的支付

在《招募说明书》之《关于恒生精选基金系列-恒生中国企业指数基金在内地销售的补充说明书》第二部分“香港互认基金的特别说明”第4条“适用于内地投资者的交易及结算程序”下第(8)点

“基金的申购、赎回与转换的规则”之“viii. 申购款和赎回款的支付”下，明确内地投资者应向内地销售机构查询有关支付申购款项及赎回款项的详情。

6. 暂停申购情形

在《招募说明书》之《关于恒生精选基金系列-恒生中国企业指数基金在内地销售的补充说明书》第二部分“香港互认基金的特别说明”第4条“适用于内地投资者的交易及结算程序”下第(8)点“基金的申购、赎回与转换的规则”之“x. 暂停申购和赎回的情形”下，补充说明，如本基金内地销售规模百分比达到45%，内地代理人将视乎情况暂停申购申请；若在内地销售的全部香港互认基金的销售额度达到国家外汇管理局规定的额度或者不时调整的额度，本基金亦将暂停申购申请。

7. 巨额赎回

在《招募说明书》之《关于恒生精选基金系列-恒生中国企业指数基金在内地销售的补充说明书》第二部分“香港互认基金的特别说明”第4条“适用于内地投资者的交易及结算程序”下第(8)点“基金的申购、赎回与转换的规则”之“xi. 巨额赎回”下，补充说明目前内地登记结算机构及内地代理人的技术条件仅能支持在触发前述赎回限制情形时，内地投资者的赎回申请被部分确认后，未确认的赎回申请将被拒绝，不支持顺延处理。

8. 名义持有人安排

在《招募说明书》之《关于恒生精选基金系列-恒生中国企业指数基金在内地销售的补充说明书》第三部分“香港互认基金的风险揭示”第2条“香港互认基金的风险”下第(3)点“销售安排差异的风险”中，对名义持有人安排进行补充说明，即内地投资者对基金管理人及/或受托人若有任何权利主张，可通过名义持有人向基金管理人及/或受托人提出，若名义持有人怠于向基金管理人及/或受托人提出有关权利主张，内地投资者可依据其与名义持有人就名义持有安排作出的约定，促使名义持有人履行相关义务。

9. 人民币及兑换风险

更新《招募说明书》之《关于恒生精选基金系列-恒生中国企业指数基金在内地销售的补充说明书》第三部分“香港互认基金的风险揭示”第2条“香港互认基金的风险”下的“(4)人民币及兑换风险”。

10. 份额类别货币风险

在《招募说明书》之《关于恒生精选基金系列-恒生中国企业指数基金在内地销售的补充说明书》第三部分“香港互认基金的风险揭示”第2条“香港互认基金的风险”下，补充“(5)份额类别货币风险”，说明本基金报价货币为港元，内地投资者投资于以人民币计价的份额类别，则内地投资者须承担相关货币兑换风险。

11. 内地代理人、内地销售机构或内地登记结算机构的操作风险、技术风险

在《招募说明书》之《关于恒生精选基金系列-恒生中国企业指数基金在内地销售的补充说明书》第三部分“香港互认基金的风险揭示”第2条“香港互认基金的风险”之“(8)内地代理人、内地销售机构或内地登记结算机构的操作风险、技术风险”中，补充内地登记结算机构亦存在操作风险、技术风险。

12. 备查文件的查阅

在《招募说明书》之《关于恒生精选基金系列-恒生中国企业指数基金在内地销售的补充说明书》第四部分“本基金在内地的信息披露（种类、时间和方式）”中，澄清说明内地投资者可在任何一日（星期六、星期日及公众假期除外）的一般工作时间查阅备查文件。

13. 查询本基金的资料

在《招募说明书》之《关于恒生精选基金系列-恒生中国企业指数基金在内地销售的补充说明书》第九部分“对内地投资者的服务”下的第3条“查询、建议或投诉”中，明确内地投资者可浏览内地代理人的网站 www.ccb.com，以了解本基金的进一步资料。

14. 本基金的投资目标及政策、标的指数和目标基金

在《招募说明书》之《关于恒生精选基金系列-恒生中国企业指数基金在内地销售的补充说明书》第十部分“对内地投资者有重大影响的信息”下的第2条“本基金的投资目标及政策”以及第6条“本基金的标的指数和目标基金”中，根据本次《关于恒生中国企业指数基金的特别条款》的更新，在《关于恒生精选基金系列-恒生中国企业指数基金在内地销售的补充说明书》中同步明确本基金为一只联接基金及指数基金，本基金以尽实际可能取得接近恒生中国企业指数于香港联合交易所有限公司每个上午及下午交易时段的总回报表现（扣除预扣税后）。

15. 联接基金与直接投资基金转换

在《招募说明书》之《关于恒生精选基金系列-恒生中国企业指数基金在内地销售的补充说明书》第十部分“对内地投资者有重大影响的信息”下的第7条“联接基金与直接投资基金的转换”中，根据本次《关于恒生中国企业指数基金的特别条款》的更新，在《关于恒生精选基金系列-恒生中国企业指数基金在内地销售的补充说明书》中同步明确联接基金与直接投资基金的转换须取得香港证券及期货事务监察委员会（“香港证监会”）的事先批准。

16. 内地代理人网址

在《招募说明书》之《关于恒生精选基金系列-恒生中国企业指数基金在内地销售的补充说明书》中提及内地代理人网址之处，补充说明内地代理人网址未经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）审阅。

17. 因应香港证监会的最低披露规定加强披露

为遵守香港证监会《单位信托及互惠基金认可申请的常规及程序指南》所载的最低披露规定，基金管理人加强了于《招募说明书》之《恒生精选基金系列基金说明书》及《关于恒生中国企业指数基金的特别条款》的披露。尤其是，已加强披露本基金的投资政策及策略以反映本基金的现有做法，并已修订风险披露以向投资者提供更适当的资料，包括但不限于：

- (1) 在《招募说明书》之《恒生精选基金系列基金说明书》中“风险因素”一节，在“一般风险”一节下更新并补充了投资风险、集中风险、汇率风险、类别货币风险、欧元区风险、与灵活资产配置策略有关的风险、与从基金资本作出收益分配有关的风险、利益冲突风险、依赖同一个集团的风险；在“直接投资基金须承受的风险”一节下，加强了对投资于股票基金须承受的风险、投资于定息工具基金须承受的风险、投资于中小型市值企业基金

须承受的风险、投资于新兴和发展中市场之基金须承受的风险、与投资于其他集体投资计划有关的风险、投资于衍生工具基金须承受的风险、与股票市场互联互通机制有关的风险、与债券通有关的风险等风险披露；在“基金中基金须承受的风险”中对投资于集体投资计划的风险进行了完善；在“指数基金须承受的风险”中，加强了“被动式投资涉及的风险”、“追踪误差风险”及“集中风险”的披露。

需要说明的是，鉴于本基金为联接基金、指数基金，本基金须承受的风险包括一般风险、直接投资基金须承受的风险、联接基金须承受的风险、指数基金须承受的风险，其他所披露的风险不适用于本基金。

- (2) 在《招募说明书》之《恒生精选基金系列基金说明书》“投资管理”一节中，对恒生银行有限公司的网点数量及所在地区进行更新。
- (3) 在《招募说明书》之《恒生精选基金系列基金说明书》中补充“收益分配政策”一节。

需要说明的是，适用于本基金现时在内地销售的 M 类人民币（对冲）份额的收益分配政策载于《招募说明书》之《关于恒生精选基金系列-恒生中国企业指数基金在内地销售的补充说明书》，并未发生修改。

- (4) 在《招募说明书》之《恒生精选基金系列基金说明书》“税务及监管规定”一节中，对中国内地的税项、美国的《海外账户纳税法案》进行更新。
- (5) 鉴于本基金已经中国证监会注册，在《招募说明书》之《关于恒生中国企业指数基金的特别条款》中补充声明中国证监会对本基金的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。
- (6) 在《招募说明书》之《关于恒生中国企业指数基金的特别条款》中，对本基金的投资目标及政策加强了披露，说明本基金是一只联接基金及指数基金；本基金通过单一投资于目标基金，以尽实际可能取得接近恒生中国企业指数于香港联合交易所有限公司每个上午及下午交易时段的总回报表现（扣除预扣税后）；金融衍生工具不会被广泛用作投资；联接基金与直接投资基金的转换须取得香港证监会的事先批准。
- (7) 在《招募说明书》之《关于恒生中国企业指数基金的特别条款》中补充“对该指数作出重大改变”，说明可能影响恒生中国企业指数可接纳性的事件将征询香港证监会的意见，也将通知基金份额持有人有关恒生中国企业指数的重大事件。
- (8) 在《招募说明书》之《关于恒生中国企业指数基金的特别条款》“风险因素”一节中，对股票市场风险、与基金的结构/目标基金有关的风险、涉及新兴市场投资的一般性风险、人民币及兑换风险、货币对冲风险、类别货币风险、终止风险、依赖同一个集团的风险、与投资于金融衍生工具有关的风险进行了补充与更新。
- (9) 在《招募说明书》之《关于恒生中国企业指数基金的特别条款》“投资限制”一节中，对目标基金“恒生中国企业指数上市基金”的投资限制进行了归纳总结。
- (10) 对《招募说明书》之《关于恒生中国企业指数基金的特别条款》附件二的指数资料（例如恒生中国企业指数基金的 10 只最大成份股各自的比重）进行了更新。

(11)对《招募说明书》之《关于恒生中国企业指数基金的特别条款》附件二的指数免责声明进行了更新。

(12)在《招募说明书》之《恒生精选基金系列基金说明书》、《关于恒生中国企业指数基金的特别条款》中提及基金管理人网址之处，补充说明基金管理人网址未经香港证监会审阅。

18. 完善表述、整合文件

本次亦对《招募说明书》的相关表述进行了完善，并且整合自2016年2月以来的《招募说明书》历次修订。

二、《产品资料概要》的更新

1. 资料一览

在“资料一览”中补充内地代理人、本基金的报价货币的信息；更新本基金的全年经常性开支比率，在相应注释中说明此次数据更新所依据的时间截点；在注释中补充本基金内地销售的工作日的定义。

2. 目标及投资策略

明确本基金是一只联接基金及指数基金；本基金的投资目标是尽实际可能取得接近恒生中国企业指数于香港联合交易所有限公司每个上午及下午交易时段的总回报表现（扣除预扣税后）；补充恒生中国企业指数的基本信息；更新了截至2018年8月20日的指数资料。

3. 香港互认基金的特别说明

补充了“香港互认基金的特别说明”一节，内容覆盖关于本基金在内地的注册、本基金应满足的香港互认基金的条件及不满足时的处理方案、关于公平对待内地投资者的声明、基金管理人的内地代理人、适用于内地投资者的交易及结算程序、销售数据交换、销售资金交收。

4. 风险披露

(1) 更新了本基金的一般投资风险、类别货币风险、股票市场风险、与基金的结构/目标基金有关的风险、追踪误差风险、被动式投资风险、投资于目标基金的风险、集中风险、与在二级市场交易有关的风险、涉及新兴市场投资的一般性风险、依赖同一个集团的风险、终止风险、与投资于金融衍生工具有关的风险。

(2) 更新了本基金作为香港互认基金的特有风险，如销售安排差异的风险、人民币及兑换风险、份额类别货币风险、内地代理人、内地销售机构或内地登记结算机构的操作风险、技术风险。

5. 内地代理人网址

在提及内地代理人网址之处，补充说明内地代理人网址未经中国证监会审阅。

6. 基金管理人网址

在提及基金管理人网址之处，补充说明基金管理人网址未经香港证监会审阅。

7. 完善表述

基金管理人对《产品资料概要》的相关表述进行了完善，以使得相关表述和《招募说明书》保持一致。

三、重要提示

1. 投资者在办理基金交易前，请仔细阅读登载在本基金内地代理人的网站(<http://www.ccb.com>)的本基金《招募说明书》、《产品资料概要》及《信托契约》等相关法律文件及公告，并确保遵循其规定。
2. 本基金作为香港互认基金在内地公开销售，其投资运作、风险特征、法律法规适用等与内地基金产品不同，敬请投资者认真阅读上述本基金法律文件及公告（包括当中的风险揭示内容），谨慎做出投资决策。
3. 投资者可拨打本基金内地代理人的客户服务热线**95533**或通过本基金内地代理人的客户服务电子邮箱 ccbzf.zh@ccb.com 垂询相关事宜，或访问本基金内地代理人的网站 (<http://www.ccb.com>) 查询。

四、风险提示

投资涉及风险（包括可能会损失投资本金），基金份额净值可升可跌，过往表现并不可作为日后表现的指引。投资前请参阅本基金《招募说明书》、《产品资料概要》及《信托契约》等相关法律文件及公告所载详情，包括投资于本基金的主要风险、对于内地投资者的特殊风险以及有关本基金作为香港互认基金的特有风险。

本基金系依据《香港互认基金管理暂行规定》经中国证监会注册后在内地公开销售的香港互认基金。但中国证监会对本基金的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人就本公告内容之准确性承担责任。

特此公告。

基金管理人：恒生投资管理有限公司
内地代理人：中国建设银行股份有限公司
2018年9月14日