

## 恒生精选基金系列 - 恒生中国企业指数基金（“本基金”）

此乃重要文件，务请投资者实时关注。如投资者对本文件的内容有任何疑问，应寻求独立及专业的财务意见。

投资者请注意，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。投资者在作出任何投资决定前，应详阅《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》”）、《恒生中国企业指数基金产品资料概要》（“《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》经中国证券监督管理委员会（“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。

### 《恒生精选基金系列-恒生中国企业指数基金招募说明书》之修订

《招募说明书》自本文件发布之日起作出以下修订。以下修订构成《招募说明书》的一部分，应与《招募说明书》一并阅读。

#### 一、对《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》进行的修订

将第三部分“**香港互认基金的风险揭示**”之“2、香港互认基金的风险”部分下“(6)货币对冲风险”的内容全部删去并由下文取代：

“就M类人民币（对冲）份额而言，本基金可尝试将该份额类别的计价货币与本基金的报价货币或本基金相关资产的货币对冲。对冲交易的成本将于该等份额类别的资产净值中反映，因此，M类人民币（对冲）份额的内地投资者将须承担相关对冲成本，而该成本可能相当高昂（视乎当时的市况而定）。

如为对冲目的而用的投资工具交易对手方违约，M类人民币（对冲）份额的内地投资者可能须承受未对冲的货币兑换风险，并因而蒙受进一步亏损。

此外，不保证对冲策略将会有效，M类人民币（对冲）份额的内地投资者仍可能须承受货币兑换风险。货币对冲所造成的任何盈利或亏损应累计至相关货币对冲类别的价值。

尽管并非其意愿，但在基金管理人尝试对冲货币波动时，仍可能导致出现对冲过度或对冲不足的持仓。再者，因货币敞口对冲过度，对冲交易衍生工具持仓可能引发与杠杆有关的风险，M类人民币（对冲）份额的内地投资者可能会面临与该对冲类别计价货币以外的货币有关的风险（即与人民币以外的货币有关的风险）。内地投资者须注意，不论M类人民币（对冲）份额的计价货币相对本基金的报价货币及/或本基金相关资产的货币价值下跌或上升，均可能会进行对冲交易，如有进行对冲，其可能会大大保障该类别的内地投资者免受本基金的报价货币及/或本基金相关资产的货币相对于该类别的类别货币的价值下跌的影响，但其亦可能会阻碍该类别的内地投资者从本基金的报价货币及/或本基金相关资产的货币的价值上升中受益。

若内地投资者使用的货币与M类人民币（对冲）份额的货币（即人民币）不同，可能会承受额外的货币风险。”

#### 二、对《招募说明书》之《恒生精选基金系列基金说明书》进行的修订

##### 风险因素

##### 1. 将分节标题为“**一般风险**”下标题为“货币对冲风险”的部分全部删去并由下文取代：

###### “货币对冲风险

基金可尝试将基金份额类别的计价货币与基金的报价货币或相关资产的货币对冲。对冲交易的成本将于该等基金份额类别的资产净值中反映，因此，对冲类别的基金份额持有人将须承担相关对冲成本，而该成本可能相当高昂（视乎当时的市况而定）。

如为对冲目的而用的投资工具交易对手方违约，对冲类别的基金份额持有人可能须承受未对冲的货币兑换风险，并因而蒙受进一步亏损。

此外，不保证对冲策略将会有效，基金份额持有人仍可能须承受货币兑换风险。货币对冲所造成的任何盈利或亏损应累计至相关货币对冲类别的价值。

尽管并非其意愿，但在基金管理人尝试对冲货币波动时，仍可能导致出现对冲过度或对冲不足的持仓。再者，因货币敞口对冲过度，对冲交易衍生工具持仓可能引发与杠杆有关的风险，对冲类别的基金份额持有人可能会面临与该对冲类别计价货币以外的货币有关的风险。投资者须注意，不论对冲类别的计价货币相对基金的报价货币及/或相关资产的货币价值下跌或上升，均可能会进行对冲交易，如有进行对冲，其可能会大大保障对冲类别的基金份额持有人免受基金的报价货币及/或相关资产的货币相对于对冲类别的类别货币的价值下跌的影响，但其亦可能会阻碍基金份额持有人从基金的报价货币及/或相关资产的货币的价值上升中受益。

若基金份额持有人的报价货币与对冲类别的货币不同，可能会承担额外的货币风险。”

2. 在分节标题为“**直接投资基金须承受的风险**”下标题为“投资于衍生工具的基金须承受的风险”的部分之后加入以下内容：

“有关恒生指数期货合约/恒生中国企业指数期货合约持有数目限制的风险

《证券及期货条例》下的《证券及期货（合约限量及须申报的持仓量）规则》（“《期货规则》”）目前限制任何人士为其自身账户或为他人（但受其控制）持有期货合约或股票期权合约。因此，不仅基金持有或控制的持仓不可超过规定的持仓限额，由基金管理人持有或控制的持仓，包括为基金管理人自身账户或为其管理的基金（例如基金）持有但由基金管理人控制的持仓合计亦不可超过有关上限。因此，基金进一步购入恒生指数期货合约（“恒指期货”）/小型恒指期货/恒生中国企业指数期货合约（“恒生国指期货”）/小型恒生国指期货的能力可能因基金管理人持有或控制其他期货/期权合约而受到影响（包括为其他基金持有或控制的小型恒指期货及期权合约/小型恒生国指期货及期权合约、恒生指数期权合约/恒生中国企业指数期权合约及持仓）。由于基金份额持有人自身并不持有恒指期货/小型恒指期货/恒生国指期货/小型恒生国指期货或控制基金，基金份额持有人持有份额并不会使该名基金份额持有人受《期货规则》所限制。虽然基金管理人预期这不会对基金有任何即时影响，但如果基金管理人持有或控制的持仓达到有关持仓限额，或如果基金的资产净值大幅增长，《期货规则》载明的限制可能会阻碍份额的申购，因为基金根据《期货规则》不能进一步购入恒指期货/小型恒指期货/恒生国指期货/小型恒生国指期货，所持投资亦可能偏离目标投资从而增加基金的追踪误差。”

倘若投资者对上述事宜有任何疑问，请致电本基金内地代理人的客户服务热线 95533。

基金管理人对本文件所载资料于其发布之日之准确性承担全部责任。

恒生投资管理有限公司  
2020年11月24日