

恒生精选基金系列 - 恒生指数基金（“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-恒生指数基金招募说明书》（“《招募说明书》”）、《恒生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。

对《招募说明书》之《关于恒生指数基金的特别条款》进行的修订

附件一全部删去并由下文取代：

“附件一

恒生指数（‘该指数’）

概览

该指数于 1969 年 11 月 24 日推出，为反映香港股票市场整体表现的指标。该指数以港元计价，并以截至 1964 年 7 月 31 日的 100 点为基值计算。该指数在香港联交所的交易时段内每隔 2 秒实时计算及报价一次。

该指数是由恒生指数有限公司编制和管理，恒生指数有限公司是恒生银行的全资附属公司。

共有四个分类指数：金融、公用事业、地产和工商业。

本基金旨在尽实际可能取得（未计费用及支出）接近该指数的总回报版本的表现（扣除预扣税）。

选股范畴

指数评估数据截止日的恒生综合大中型股指数成份股；不包括外国公司、合订证券及股票名称以‘B’结尾的生物科技公司。

资格标准

市值要求

恒生综合大中型股指数成份股

成交量要求

投资类指数的换手率测试：如果某一证券在当月的换手率为 0.1%或以上，则该证券被视为通过了该月的换手率测试（换手率测试详情如恒生指数有限公司发布的指数编算总则中所述）

上市年限要求

至少三个月（计算至指数评估会议当日）

地域性要求

大中华区公司

成份股筛选

按行业类别筛选

合资格证券将根据恒生行业分类系统的行业分类而被分配至以下行业类别：

行业类别	恒生行业分类系统
1	金融业
2	资讯科技业
3	非必需性消费、必需性消费
4	地产建筑业
5	电讯业、公用事业
6	医疗保健业
7	能源业、原材料业、工业、综合企业

行业类别的构成会至少每两年评估一次。

决定每个行业类别成份股数目的考虑因素

每个行业类别的成份股数目将按以下原则决定：

- 目标是使每个行业类别的市值覆盖率不低于 50%；
- 行业类别的特征，包括上市公司市值及数目的分布；及
- 行业类别在该指数的占比与其在市场中占比的比较。

该指数将保持 20 至 25 只被归类为香港公司的成份股，此数目会至少每两年评估一次。

选股原则

一般而言，每个行业类别里的合资格证券将按以下考虑因素评估：

- 代表性；
- 市值；
- 成交量；及
- 财务表现。

可能会发生跨行业类别的成份股变动，以恢复行业均衡。

每次评估可能会也可能不会新增或剔除成份股。

现有成份股如果不再符合资格要求会被考虑剔除；如有合适的候选证券，行业类别内最小及成交最不活跃的现有成份股同样会被考虑从该指数中剔除。

恒生指数顾问委员会在考虑上述因素后决定最终的成份股。

成份股数目

计划于 2022 年年中之前达到 80 只，并且最终固定数目为 100 只。

评估周期

该指数的成份股每季度评估一次。

该指数计算

该指数采用流通市值加权法计算，个别证券的比重上限为 8%。

其他资料

截至 2021 年 4 月 16 日，该指数由 55 只于香港联交所上市的成份股组成，总市值为 121,384 亿港元。该指数成份股及其各自的比重可于该指数的提供者恒生指数有限公司的网页 www.hsi.com.hk*浏览。

该指数的实时更新可从 Refinitiv、Bloomberg 及恒生指数有限公司的网页 www.hsi.com.hk*获取。该指数的编算方法及该指数的其他重要消息，可从恒生指数有限公司的网页 www.hsi.com.hk*获取。

请注意：

- 组成该指数的成份股名单由恒生指数有限公司每季评估一次。如果任何成份股公司将其股份除牌，则或会更改组成有关指数的成份股公司及以其他公司（由恒生指数有限公司决定）替代。
- 假如编制及 / 或计算该指数的系统出现问题，则计算该指数的准确性及完整性可能会受影响。
- 按照特许协议书中有关使用该指数条款的规定，对于恒生指数有限公司或恒生资讯服务有限公司的作为或不作为，或就本基金的买卖或在该买卖当中该指数的使用、该指数的计算或在计算该指数或就此收集或使用有关资料时出现的任何错误、失误或遗漏，而蒙受（包括任何现在、之前或将来的基金份额持有人或投资者提出的任何索偿）的任何性质损失（但不以该类损失为限），基金管理人将对恒生指数有限公司或恒生资讯服务有限公司作出弥偿（但因恒生指数有限公司或恒生资讯服务有限公司的故意不当行为、不忠诚或不诚实行为而引致的损失除外）。对于基金管理人或其他任何正式委任的代理人在履行及遵守特许协议书的条款时所犯的过失，及任何该指数的滥用或未获授权的使用，以致恒生指数有限公司或恒生资讯服务有限公司蒙受的任何损失（但不以该类损失为限），基金管理人也将全部按完全弥偿基准作出弥偿。由于基金管理人有权就其收到的任何索偿（包括与特许协议书有关的索偿），从本基金的资产中获得弥偿（前提条件是该索偿引致的损失并非由于基金管理人的疏忽、失责、失职或背信所致），本基金的资产净值可能会因此而减少。

指数的免责声明

恒生指数（‘该（等）指数’）由恒生指数有限公司根据恒生资讯服务有限公司特许协议发布及编制。‘恒生指数’的标记及名称由恒生资讯服务有限公司拥有。恒生指数有限公司及恒生资讯服务有限公司已同意恒生投资管理有限公司可就恒生指数基金（‘本产品’）使用及引述该（等）指数，但是，恒生指数有限公司及恒生资讯服务有限公司并没有就(i)任何该（等）指数及其计算或与之有关的任何其他资料的准确性及完整性；或(ii)任何该（等）指数或其中任何成份或其所包含的资料作任何用途的适用性或适合性；或(iii)任何人士因使用任何该（等）指数或其中任何成份或其所包含的资料作任何用途而引致的结果，而向本产品的任何经纪或本产品持有人或任何其他人士作出保证或声明或担保，也不会就任何该（等）指数作出或默示任何保证、声明或担保。恒生指数有限公司可随时更改或修改计算及编制该（等）指数及其任何有关公式、成份股份及系数的过程及基准，而无须作出通知。在法律允许的范围内，恒生指数有限公司或恒生资讯服务有限公司不会因(i)恒生投资管理有限公司就本产品引用及/或参考任何该（等）指数；或(ii)恒生指数有限公司在计算任何该（等）指数时的任何不准确、遗漏、失误或错误；或(iii)与计算任何该（等）指数有关并由任何其他人士提供的资料的任何不准确、遗漏、失误、错误或不完整；或(iv)任何经纪、本产品持有人或任何其他处置本产品的人士，因上述原

*此网站内容未经香港证监会审阅。

因而直接或间接蒙受的任何经济或其他损失承担任何责任。任何经纪、持有人或任何其他处置本产品的人士，不得因有关本产品，以任何形式向恒生指数有限公司及 / 或恒生资讯服务有限公司进行索偿、法律行动或法律诉讼。任何经纪、持有人或任何其他处置本产品的人士，须完全了解本免责声明，并且不能依赖恒生指数有限公司及恒生资讯服务有限公司。为免产生疑问，本免责声明并不会在任何经纪、持有人或任何其他人士与恒生指数有限公司及 / 或恒生资讯服务有限公司之间构成任何合约或准合约关系，也不应视作已构成此等合约关系。”

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

2021年6月7日