

## 恒生投資指數基金系列

### 恒生中國企業指數上市基金

(港元櫃台股份代號：02828 / 人民幣櫃台股份代號：82828)

(「本基金」)

此乃重要文件，務請閣下即時垂注。閣下如對本文件之內容有任何疑問，應尋求獨立及專業的財務意見。

投資者須注意，所有投資均涉及風險（包括可能會損失投資本金），基金單位價格可升亦可跌，過往表現並不可作為日後表現的指引。投資者在作出任何投資決定前，應詳細閱讀有關本基金之香港銷售文件（包括產品資料概要及當中所載之風險因素之全文）。

香港聯合交易所有限公司（「聯交所」）、香港中央結算有限公司（「香港結算」）及證券及期貨事務監察委員會（「證監會」）對本文件之內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並明確表示不會就本文件全部或任何部分內容所產生或因依賴該等內容而引起的任何損失承擔任何責任。

證監會認可不等如對計劃作出推介或認許，亦不是對計劃的商業利弊或表現作出保證，更不代表計劃適合所有投資者，或認許計劃適合任何個別投資者或任何類別的投資者。

### 本基金香港銷售文件之修訂

本基金的香港銷售文件由本文件刊發日起作出以下修訂。該等修訂構成本基金的香港銷售文件的一部分，並應與本基金的香港銷售文件一併閱讀。

#### 附錄二 - 有關恒生中國企業指數的資料

附錄二被全部刪去並由下文取代：

「附錄二 - 有關該指數的資料

#### 概覽

該指數於1994年8月8日推出，追蹤下列的表現：

- H股 – 一些於內地註冊成立的企業在聯交所上市及主要在香港買賣的股票；
- 紅籌股 – 一些於中國境外註冊成立的公司在聯交所上市的證券，其來自內地的銷售收入（或利潤或資產，如更合適）超過50%，並直接或間接由中國國家、省或市擁有的組織或企業所控制；及
- P股 – 一些於中國境外註冊成立的公司在聯交所上市的證券，其來自內地的銷售收入（或利潤或資產，如更合適）超過50%，但並不是H股或紅籌股。

該指數的範圍包括在聯交所主板作第一上市的H股、紅籌股及P股公司。該指數的總成份股數目固定為50。

該指數按港元計值，於2000年1月3日以2000點為基值計算。該指數在聯交所進行買賣的時間內每2秒鐘更新報價一次，而收市指數是以聯交所公布的指數成份股的官方收市價為根據。

該指數是由恒生指數有限公司編製和管理，恒生指數有限公司是恒生銀行的全資附屬公司。

#### 挑選準則

為符合納入該指數，某一股份必須於檢討截止日或之前上市最少一個月及通過0.1%的成交量流通比率最低要求。每隻股份於過去12個月每月的成交量流通比率根據以下公式計算：

$$\text{成交量流通比率} = \frac{\text{於特定曆月每日成交股份數量之中位數}}{\text{截至月底已發行的流通股份調整數量}}$$

要成為該指數的新成份股，股份的成交量流通比率必須於過去12個月中最少有10個月及於最近三個月均達到成交量流通比率最低要求。現有指數成份股的成交量流通比率必須於過去12個月中最少有10個月達到成交量流通比率最低要求。

以下額外的挑選準則適用於現時並非該指數的成份股的紅籌股及P股，但不適用於H股成份股。

- i. 擁有3年上市歷史，符合「快速納入機制」的紅籌股或P股除外。在「快速納入機制」下，於內地公司中以市值計排名首10位以及首11至20位以內的紅籌股或P股的上市歷史分別只須要為至少1年及2年，就將符合資格被納入於該指數。適用於紅籌股及P股的上市歷史要求摘要如下表所示：

內地公司中的市值排名	上市歷史要求
首10位	1年
11至20位	2年
20位以下	3年

- ii. 潛在成份股過去1個月、3個月及12個月的歷史價格波幅須不高於該指數於相關時期的歷史價格波幅的3倍。
- iii. 公司在過去3個財政年度盈利、經營活動所得現金流量淨值及現金紅利須為正數。就符合上所述的「快速納入機制」的紅籌股或P股而言，這些財務記錄要求會相應調整 - 例如，在「快速納入機制」下符合資格而具有2年上市歷史的股份只須在過去2個財政年度錄得正數的盈利、經營活動所得現金流量淨值及現金紅利。

### 挑選

其後，所有合資格H股、紅籌股及P股按照下列各項排名：

- i. 總市值 - 以過去12個月的平均月底市值計；
- ii. 流通調整市值 - 以經調整後的流通市值12個月平均市值計；
- iii. 若股份上市少於12個月，上市後的平均月底市值將被用作排名。

每隻H股、紅籌股及P股的綜合市值排名根據以下公式計算：

$$\text{綜合市值排名} = \text{總市值排名} \times 50\% + \text{流通調整市值排名} \times 50\%$$

在所有合資格H股、紅籌股及P股中位列最高綜合市值排名的50隻合資格股份將被選為該指數的成份股，但須受限於以下段落所述的過渡性安排。

在2019年6月17日之前，該指數的組成固定為40隻H股及10隻紅籌股及/或P股。由2019年6月17日起，紅籌股及P股成份股的數目限制被移除。為了減低對市場的潛在影響，在此改動後該指數之首兩個指數調整日，成份股變動數目上限會限制為5隻，及最多5隻新的紅籌股及/或P股可被納入該指數，如下表所示：

按成份股類別分類的該指數成份股數目	指數調整日		
	2019年6月17日	2019年9月9日	2019年12月9日及之後
H股成份股	最少35隻	最少30隻	無上/下限
紅籌股及/或P股成份股	最多15隻	最多20隻	無上/下限
總數	50	50	50

### 該指數計算

該指數為總回報指數並採用流通調整市值加權法計算，每隻成份股的比重上限設定為10%。

於 2019 年 6 月 10 日，該指數由 50 隻成份股組成，總市值為 48,855 億港元，該指數之 10 隻最大成份股各自的比重如下：

股票編號	股票名稱	比重 (%)
700	騰訊控股有限公司	10.41
2318	中國平安保險（集團）股份有限公司 - H 股	9.97
939	中國建設銀行股份有限公司 - H 股	9.72
941	中國移動有限公司	8.81
1398	中國工商銀行股份有限公司 - H 股	8.58
3988	中國銀行股份有限公司 - H 股	5.27
883	中國海洋石油有限公司	4.66
3968	招商銀行股份有限公司 - H 股	3.04
2628	中國人壽保險股份有限公司 - H 股	2.78
386	中國石油化工股份有限公司 - H 股	2.72

該指數的更新報價可從聯交所的電子報價系統、Thomson Reuters、Bloomberg 及恒生指數有限公司的互聯網網址 [www.hsi.com.hk](http://www.hsi.com.hk) 取得。其他該指數的重要消息，可從新聞稿及恒生指數有限公司之網頁 [www.hsi.com.hk](http://www.hsi.com.hk) 取得。

請注意：

- 組成該指數的成份股名單由恒生指數有限公司每季檢討一次。該指數之成份或會被更改，及其成份公司或會由其他公司（由恒生指數有限公司決定）替代。
- 假如編製及/或計算該指數的系統出現問題，則計算該指數的準確性及完整性可能會受影響。
- 按照特許協議書中有關使用該指數條款之規定，基金經理將就恒生指數有限公司或恒生資訊服務有限公司，因其等之作為或不作為，或就恒生中國企業ETF之買賣或在該買賣當中該指數的使用、該指數的計算或在計算該指數或就此收集或使用有關資料時出現之任何錯誤、失誤或遺漏，遭受包括任何現在、以前或將來的基金單位持有人或投資者之任何索償，而蒙受之任何性質之損失（但不以該類損失為限），作出彌償（但因恒生指數有限公司或恒生資訊服務有限公司之故意不當行為、不忠誠或不誠實而引致之損失除外）。就基金經理或其他任何正式委任之代理人在履行及遵守特許協議書的條款時所犯之過失，及任何該指數的濫用或未獲授權的使用，以致恒生指數有限公司或恒生資訊服務有限公司蒙受任何損失（但不以該類損失為限），基金經理亦將悉數按完全彌償基準作出彌償。由於基金經理有權就其收到之任何索償（包括與特許協議書有關之索償），從恒生中國企業ETF之資產中獲得彌償（惟該索償引致之損失，必須並非由於基金經理之疏忽、失責、失職或背信所致），故此，恒生中國企業ETF之資產淨值有機會因此而減少。

免責聲明

恒生中國企業指數（「該指數」）乃由恒生指數有限公司根據恒生資訊服務有限公司特許協議發布及編製。「恒生中國企業指數」之標記及名稱由恒生資訊服務有限公司擁有。恒生指數有限公司及恒生資訊服務有限公司已同意恒生投資管理有限公司可就恒生中國企業ETF使用及引述該指數，惟恒生指數有限公司及恒生資訊服務有限公司並無就(i)任何該指數及其計算或任何其他與之有關的資料的準確性及完整性；或(ii)任何該指數或其中任何成份或其所包涵的資料作任何用途之適用性或適合性；或(iii)任何人士因使用任何該指數或其中任何成份或其所包涵的資料作任何用途而引致之結果，而向恒生中國企業ETF之任何經紀或恒生中國企業ETF持有人或任何其他人士作出保證或聲明或擔保，亦不會就任何該指數提供或默示任何保證、聲明或擔保。恒生指數有限公司可隨時更改或修改計算及編製該指數及其任何有關程式、成份股份及系數之過程及基準，而無須作出通知。於法律容許的範圍內，恒生指數有限公司及恒生資訊服務有限公司不會因(i)恒生投資管理有限公司就恒生中國企業ETF引用及/或參考任何該指數；或(ii)恒生指數有限公司在計算任何該指數時的任何失準、遺漏、失誤或錯誤；或(iii)與計算任何該指數有關並由任何其他人士提供的資料的任何失準、遺漏、失誤、錯誤或不完整；或(iv)任何經紀、恒生中國企業ETF持有人或任何其他處置恒生中國企業ETF的人士，因上述原因而直接或間接蒙受的任何經濟或其他損失承擔任何責任。任何經紀、恒生中國企業ETF持有人或任何其他處置恒生中國企業ETF的人士，不得就恒生中國企業ETF，以任何形式向恒生指數有限公司及/或恒生資訊服務有限公司進行索償、法律

**行動或法律訴訟。**任何經紀、恒生中國企業ETF持有人或任何其他處置恒生中國企業ETF的人士，須完全了解此免責聲明，並且不能依賴恒生指數有限公司及恒生資訊服務有限公司。為免生疑問，本免責聲明並不會於任何經紀、恒生中國企業ETF持有人或任何其他人士與恒生指數有限公司及／或恒生資訊服務有限公司之間構成任何合約或準合約關係，而亦不應視作已構成該等合約關係。」

倘若閣下對上述事宜有任何疑問，請於辦公時間內致電 (852) 2198 5890 與我們聯絡。

我們對本文件所載資料於其刊發日之準確性承擔全部責任。

恒生投資管理有限公司  
2019年6月17日