

此乃重要文件，請即處理。閣下如對本文件的內容有任何疑問，閣下應向閣下的股票經紀、會計師、銀行經理、財務策劃師、委託代理人、律師或其他獨立專業顧問查詢。

海通國際資產管理（香港）有限公司（「**基金經理**」）對本通知所載的資料的準確性承擔全部責任，並於作出一切合理查詢後確認，就其所知所信，本通知並無遺漏任何其他事實以致當中所載任何陳述具有誤導成分。

本通知所用但並無另行界定的詞彙具有海通人民幣投資基金系列（「**本基金**」）日期為 2019 年 12 月的註釋備忘錄（經不時修訂及補充）（「**註釋備忘錄**」）所賦予的涵義。

2019 年 12 月 31 日

## 致單位持有人的通知

海通人民幣投資基金系列（「**本基金**」）

- 海通環球人民幣收益基金
- 海通中國人民幣收益基金  
（各為「子基金」，統稱為「該等子基金」）

反映經修訂《單位信託及互惠基金守則》規定的修訂

致單位持有人：

我們特此致函通知閣下關於本基金及該等子基金的若干變動。

### A. 背景

本基金及該等子基金受香港證券及期貨事務監察委員會（「**證監會**」）發佈的《單位信託及互惠基金守則》（「**守則**」）規限。該守則已經修訂。信託契據已經透過修訂及替代契據（「**修訂及替代契據**」）的方式予以修訂，並已修訂註釋備忘錄（「**經修訂註釋備忘錄**」），以反映經修訂守則項下的規定。

### B. 根據經修訂的守則作出的變更

由 2019 年 12 月 31 日起，信託契據及／或註釋備忘錄（如適用）作出下列主要變更，以反映經修訂守則項下的規定：

1. 受託人及基金經理 - 經修訂守則第 4 及 5 章項下受託人及基金經理的額外責任。
2. 投資限制：核心規定 - 反映經修訂守則第 7 章項下有關投資限制及禁制的核心要求的修訂，包括（但不限於）有關下列各項的修訂：投資分布、商品、借出貸款限制、借款限制、金融衍生工具及抵押品等。

經修訂守則項下的主要經修訂投資限制／規定概要載列於本通知隨附的附件 A。

根據證監會發出的規定及指引計算的各子基金的衍生工具風險承擔淨額資料載於本通知附件 B 內。

3. 其他修訂 –其他修訂及加強披露，包括下列各項：

- (a) 反映經修訂守則項下有關與關連人士的交易及非金錢利益安排的規定的修訂；及
- (b) 反映經修訂守則規定的有關於子基金終止時處理單位持有人未有申領款項的安排的加強披露。

請參閱經修訂的註釋備忘錄及修訂及替代契據，了解進一步詳情。

**C. 投資於具虧損吸收特徵的債務工具**

海通環球人民幣收益基金及海通中國人民幣收益基金的投資政策經修改，規定各子基金可將其資產淨值中少於 30% 的部分投資於具虧損吸收特徵的債務工具（如或然可轉換債務證券、高級非優先債務等）。

**D. 其他加強披露**

其他加強披露及雜項修訂經已於註釋備忘錄及信託契據（倘適用）內作出，包括有關使用傳真或其他電子指示認購、贖回及轉換單位的估值政策及披露。

**E. 變更的影響**

除本通知所披露外，上述變更將不會對各子基金的投資目標及風險概況產生任何重大影響。上述變更將不會增加以該等子基金的資產支付的費用。除本通知披露者外，上述變更亦不會導致本基金及該等子基金目前的營運或管理方式發生變化。

**F. 索取文件**

修訂及替代契據、經修訂註釋備忘錄及經更新的產品資料概要可於一般辦公時間內（週一至週五（公眾假期除外）上午九時正至下午六時正）聯絡香港德輔道中 189 號李寶椿大廈 22 樓的基金經理辦事處索取，或於網站 <http://www.htisec.com/asm> 下載。此網站未經證監會審閱或授權。

**G. 查詢**

如閣下對本通知任何方面存在任何疑問或需要進一步資料，請聯絡基金經理（其香港辦事處位於上述地址），或致電我們的客戶服務熱線(852) 3588 7699 查詢。

**海通國際資產管理（香港）有限公司**  
本基金及子基金的基金經理

## 附件 A

### 主要的經修訂投資限制概要

投資限制的主要修訂如下：

- (a) 子基金如果透過以下方式投資於任何單一實體或就任何單一實體承擔風險（政府及其他公共證券除外），則該子基金所作的投資或所承擔的風險的總值，不可超逾其最新可得資產淨值的 10%：
  - (i) 對該實體發行的證券作出投資；
  - (ii) 透過金融衍生工具的相關資產就該實體承擔的風險；及
  - (iii) 因與該實體就場外金融衍生工具進行交易而產生的對手方風險淨額。
- (b) 在經修訂守則的規定的規限下，子基金如果透過以下方式投資於同一個集團內的實體（即通常就根據國際公認會計準則編製的綜合財務報表而言被納入同一集團的實體）或就同一個集團內的實體承擔風險，則該子基金所作的投資或所承擔的風險的總值，不可超逾其最新可得資產淨值的 20%：
  - (i) 對該等實體發行的證券作出投資；
  - (ii) 透過金融衍生工具的相關資產就該等實體承擔的風險；及
  - (iii) 因與該等實體就場外金融衍生工具進行交易而產生的對手方風險淨額。
- (c) 子基金如果將現金存放於同一集團內一個或多個實體，則該等現金存款的價值不可超逾該子基金最新可得資產淨值的 20%，惟在經修訂的守則列明的若干情況下可超逾 20% 的上限。
- (d) 除非證監會已另行批准及於子基金的投資政策中作出披露，否則子基金不可投資於實物商品。
- (e) 在經修訂守則項下的規定規限下，子基金不可放貸、承擔債務、進行擔保、背書票據，或直接地或或然地為任何人的責任或債項承擔責任或因與任何人的責任或債項有關連而承擔責任。為免生疑問，符合經修訂守則項下規定的逆向回購交易不受本段所列限制的規限。
- (f) 海通環球人民幣收益基金的借款上限已減至其最新可得資產淨值的 10%。為免生疑問，符合經修訂守則項下規定的銷售及回購交易，則不受本段所列限制的規限。
- (g) 子基金可為對沖目的取得金融衍生工具。
- (h) 子基金亦可根據其投資目標及政策為非對沖目的而取得金融衍生工具，但該子基金與該等金融衍生工具有關的風險承擔淨額（「**衍生工具風險承擔淨額**」）不得超逾該子基金最新可得資產淨值的 50%。

衍生工具風險承擔淨額應根據守則及證監會發出的規定及指引（可不時予以更新）計算出來。為免生疑問，為對沖目的而取得的金融衍生工具若不會因有關對沖安排產生任何剩餘的衍生工具風險承擔，則將不會計入 50% 限額。

- (i) 為限制就各對手方承擔的風險，子基金可向有關對手方收取抵押品，但抵押品須符合經修訂守則的規定。

## 附件 B

### 有關衍生工具風險承擔淨額的資料

衍生工具風險承擔淨額根據守則及證監會發出的規定及指引（可能不時予以更新）計算。在計算衍生工具風險承擔淨額時，為投資目的取得並將增加子基金的投資組合槓桿水平的衍生工具換算成該等衍生工具相關資產的對應持倉。

以下子基金僅可收購金融衍生工具作對沖用途，惟以下文所載限額為限：

子基金	衍生工具風險承擔淨額 (佔資產淨值的百分比)
海通環球人民幣收益基金	最高 50%

以下子基金將不會使用金融衍生工具作任何用途：

子基金
海通中國人民幣收益基金