

重要提示：香港聯合交易所有限公司（「香港聯交所」）、香港交易及結算所有限公司、證券及期貨事務監察委員會（「證監會」）及香港中央結算有限公司對本公告的內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並明確表示不會就因本公告全部或任何部分內容而產生或因依賴該等內容而引致的任何損失承擔任何責任。

基金經理就本公告所載資料於刊發日期的準確性承擔全部責任，並在作出一切合理查詢後，就其所深知及確信，確認本公告並無遺漏其他事實足以令致本公告所載任何陳述產生誤導及本公告所表達的意見乃經審慎周詳考慮後始行達致。

證監會的認可並不等同對信託或子基金的推薦或認許，亦非保證信託或子基金在商業上的優點或其投資表現，更不代表信託或任何子基金適合所有投資者，或認許信託或子基金適合任何個別投資者或任何類別的投資者。

閣下如對本公告的內容有任何疑問，閣下應向閣下的股票經紀、銀行經理、律師、會計師或其他專業顧問查詢。

海通滬深 300 指數 ETF （「信託」）

（根據香港法例第 571 章證券及期貨條例第 104 條獲認可的香港傘子單位信託）

海通滬深 300 指數 ETF
股份代號：82811－人民幣櫃台
股份代號：02811－港幣櫃台
（「子基金」）

公告

反映經修訂《單位信託及互惠基金守則》規定的修訂

除另有所指外，本公告所有未界定詞彙與日期為 2020 年 1 月 1 日的信託及子基金認購章程所界定者具有相同涵義。基金經理就本公告所載資料於刊發日期的準確性承擔全部責任。

海通國際資產管理（香港）有限公司（信託及子基金經理人（「基金經理」））謹此向單位持有人告知以下變更：(i)反映香港證券及期貨事務監察委員會（「證監會」）發佈的經修訂《單位信託及互惠基金守則》（「守則」）規定的認購章程修訂；(ii)反映守則規定的信託的日期為 2013 年 1 月 13 日的信託契據（經不時修訂及補充）（「信託契據」）修訂；及(iii)有關認購章程的其他雜項、起草、編輯及附件更新以及修訂。除另有說明外，本公告所述變更的生效日期為 2020 年 1 月 1 日。

投資者買賣子基金單位時務請審慎行事。

致單位持有人：

A. 背景

信託及子基金受證監會發佈的守則規限。守則已經修訂。信託契據透過補充契據（「**補充契據**」）的方式予以修訂，而認購章程透過經修訂認購章程（「**經修訂認購章程**」）予以修訂，以反映經修訂守則項下的規定。

B. 信託契據及認購章程的修訂

信託契據及／或認購章程（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 及 8.6 章（非上市指數基金及跟蹤指數交易所買賣基金）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、商品投資限制、借出貸款限制、借款限制、金融衍生工具、證券融資交易及抵押品等。

經修訂守則項下的主要經修訂投資限制／規定概要載列於本公告隨附的附件 A。

經修訂認購章程及子基金的經修訂產品資料概要（「**產品資料概要**」）澄清，子基金將不會使用金融衍生工具作任何用途。

此外，經修訂守則第 8.2 章（貨幣市場基金）的投資限制亦就信託的未來子基金載入信託契據及經修訂認購章程。然而，務請注意子基金並非貨幣市場基金，因此，第 8.2 章的投資限制不適用於子基金。

有關投資限制的進一步詳情，請參閱經修訂認購章程附件 1。

3. **其他修訂** - 反映經修訂守則規定的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；
 - (b) 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；
 - (c) 反映經修訂守則有關暫停買賣單位的規定的修訂；
 - (d) 有關各子基金的可於基金經理網站查閱的資料的加強披露；及
 - (e) 免除有關子基金認購章程及產品資料概要中子基金相關指數的十大成分證券比重的披露。子基金指數的成分證券的最新列表連同其各自比重將可於認購章程所披露的相關網站內查閱。

此外，有關信託契據及認購章程的其他雜項、起草、編輯及附件更新以及修訂均已作出。

請參閱經修訂認購章程及補充契據，了解進一步詳情。

C. 受託人費用增加

自 2020 年 2 月 1 日起，受託人將提高受託人費用，外加子基金每年 4,000 美元的固定費用。為免生疑問，應付受託人（以受託人身份）費用總額不得超過信託契據所訂明及認購章程所載的每年子基金資產淨值的 1.0% 之上限。

D. 變更的影響

除本公告所披露外，上述變更將不會對子基金的投資目標及風險概況產生任何重大影響，而上述變更將不會增加以子基金的資產支付的費用。除本公告披露者外，上述變更亦不會導致信託及子基金目前的營運或管理方式發生變化。

E. 索取文件

信託契據連同所有補充性契據（包括補充契據）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）於下述地址的基金經理辦事處免費查閱。信託契據連同所有補充性契據（包括補充契據）副本可向基金經理交予合理費用申請取得。

經修訂認購章程及最新產品資料概要可於我們網站(www.haitongetf.com.hk)¹及香港聯交所網站 (www.hkex.com.hk)查閱。

F. 查詢

投資者如對上述內容有任何疑問，請於一般辦公時間內聯絡基金經理（地址為香港德輔道中 189 號李寶椿大廈 22 樓），或致電我們的查詢熱線(852) 3588 7699。

我們謹藉此機會感謝閣下的寶貴支持，希望日後能夠繼續為閣下提供服務。

海通國際資產管理（香港）有限公司
海通滬深 300 指數 ETF 的基金經理

¹此網站未經證監會審閱或認可。

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。

上述限制受守則第 8.6 章就跟蹤指數交易所買賣基金所載的更改或豁免所規限。

- (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) 子基金借款上限已減至其最新可得資產淨值 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。