

**重要提示：**香港聯合交易所有限公司、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佈之內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並表明不會就本公佈全部或任何部分內容而產生或因依賴該等內容而引致之任何損失承擔任何責任。

基金經理對本公佈所載的資料的準確性負全責，並確認經一切合理查詢後，就其所知所信，並無遺漏足以令本公佈的任何陳述具誤導成分的其他事實，而本公佈內表達的一切意見乃經審慎周詳的考慮後作出。

*證監會認可不等於推薦或認許傘子基金(定義見下文)及子基金(定義見下文)，亦不保證傘子基金及子基金的商業利弊或表現。該認可並不代表傘子基金及子基金適合所有投資者，也不代表認許傘子基金及子基金適合任何個別投資者或任何類別的投資者。*

閣下如對本公佈的內容有任何疑問，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。

**標智滬深 300 中國指數基金<sup>®</sup>**  
**W.I.S.E. – CSI 300 China Tracker<sup>®</sup>**  
**其為標智 ETFs 系列（「傘子基金」）**  
**的一個子基金（「子基金」）**

（根據《證券及期貨條例》（香港特別行政區法例第 571 章）  
第 104 條獲認可之香港單位信託）  
（股份代號：**02827**）

**公 佈**  
**修訂及更新銷售文件**

基金經理特此公佈，子基金的基金認購章程已作出若干修訂以符合經修訂的《基金經理操守準則》。而子基金的產品資料概要（「**產品資料概要**」）亦已作出更新。

基金經理特此通知投資者，子基金的基金認購章程已作出若干修訂以符合經修訂的《基金經理操守準則》。該等修訂將即時生效。詳情請參閱基金認購章程的補充文件（「**補充文件**」）。請注意，所有對基金認購章程的修訂只為闡明目的而作出。子基金的投資目標及政策、子基金及單位持有人須付的費用水平或子基金的管理模式均沒有改變。

此外，已更新的產品資料概要已刊發，以披露有關子基金的經常性開支比率的更新資料。產品資料概要「投資子基金涉及哪些費用及收費？」一節的最後部分所述的通知期已作出釐清。

與此同時，載於基金認購章程及產品資料概要有關上海證券交易所的上市公司數目及其股份市價總值、有關深圳證券交易所的上市公司數目及其股份市價總值、滬深 300

指數的十隻最大成分股資料以及滬深 300 指數的 300 隻成分股佔深圳證券交易所及上海證券交易所的市值的資料亦已更新。詳情請參閱補充文件。

子基金的最新銷售文件（包括補充文件及已更新的产品資料概要）可於香港交易及結算所有限公司網址 ([www.hkex.com.hk](http://www.hkex.com.hk)) 及基金經理的網址<sup>1</sup> ([www.boci-pru.com.hk/english/etf/intro.aspx](http://www.boci-pru.com.hk/english/etf/intro.aspx) (英文) 及 [www.boci-pru.com.hk/chinese/etf/intro.aspx](http://www.boci-pru.com.hk/chinese/etf/intro.aspx) (中文)) 內查閱。銷售文件的列印本亦可於香港中環花園道 1 號中銀大廈 27 樓向基金經理免費索取。

本公佈內未有定義的任何特定詞彙，具有與基金認購章程中所載相同的涵義。

投資者如對上述事項有任何查詢，請聯絡位於上述地址的基金經理，或可致電基金經理的查詢熱線 (852) 2280 8697。

二零一八年十一月六日

---

<sup>1</sup> 基金經理的網頁並未經證監會審閱。

**重要提示：**本補充文件乃屬日期為二零一八年七月十三日的標智滬深300中國指數基金<sup>®</sup>（「子基金」）之基金認購章程（「基金認購章程」）之補充文件，屬於基金認購章程之一部份。除非本補充文件另有規定，否則在基金認購章程中所定義的字眼及詞語在本補充文件使用時將具有相同的涵義。

基金經理對本補充文件所載的資料的準確性負全責，並確認經一切合理查詢後，就其所知所信，並無遺漏足以令本公佈的任何陳述具誤導成分的其他事實。

閣下如對基金認購章程及本補充文件的內容有任何疑問，閣下應諮詢獨立及專業的財務意見。

香港聯合交易所有限公司、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補充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，並表明不會就本補充文件全部或任何部分內容而產生或因依賴該等內容而引致之任何損失承擔任何責任。

證監會認可不等於推薦或認許傘子基金（定義見下文）及子基金，亦不保證傘子基金及子基金的商業利弊或表現。該認可並不代表傘子基金及子基金適合所有投資者，也不代表認許傘子基金及子基金適合任何個別投資者或任何類別的投資者。

**標智滬深 300 中國指數基金<sup>®</sup>**  
**W.I.S.E. – CSI 300 China Tracker<sup>®</sup>**  
**其為標智 ETFs 系列（「傘子基金」）**  
**的一個子基金**  
（根據《證券及期貨條例》（香港特別行政區法例第 571 章）  
第 104 條獲認可之香港單位信託）  
**（股份代號：02827）**

**基金認購章程之補充文件**

茲補充基金認購章程之內容如下，並即時生效：

**1. 流動性管理**

- (i) 在基金認購章程「風險因素」一節下，於第 23 至 24 頁的風險因素「(j) 流動性風險」被刪除及被以下段落取代：

## 「(j) 流動性風險

流動性風險於特定投資難以買入或沽售時存在。子基金的投資可能因市場走勢或不利的投資者情緒而缺乏流動性或流動性不足。投資於境外證券、擁有具規模市場及／或信貸風險的衍生工具或證券往往最容易受到流動性風險的影響。缺乏流動性的證券或會非常波動及較難估值及以其面值售出。子基金投資的某些市場與世界領先的股票市場相比可能流動性較低及較為波動，可能導致於該等市場買賣的證券價格波動。若干證券亦可能因其轉售的有限交易市場或合約限制而導致流動性不足。子基金承受未能輕易解除或抵消某特定投資或情況的風險。

若收到大規模的贖回要求，子基金可能需要以大幅折讓變現其投資以滿足該等贖回要求，而子基金可能會因買賣該等投資而招致虧損。因此，這可能對子基金及其投資者帶來不利影響。」

- (ii) 在基金認購章程「增設和贖回基金單位」一節下，於第 54 至 55 頁「流動性風險管理」分節下的第二及第三段被刪除及被以下段落取代：

「基金經理已訂立流動性風險管理政策，以識別、監控及管理子基金的流動性風險，並確保子基金的投資的流動性狀況將有助子基金遵守履行贖回要求的責任。該政策連同傘子基金採用的流動性管理工具，亦尋求達到在大規模贖回的情況下，公平對待單位持有人，並保障其他單位持有人的利益。

基金經理的流動性管理政策考慮到子基金的投資策略、流動性狀況及贖回政策。該等措施尋求確保對所有投資者的公平對待及透明度。

流動性管理政策包括持續監察子基金持有的投資組合，以確保該等投資適合於第 49 至 53 頁的「贖回基金單位」分節下所述的贖回政策，及將有助子基金遵守履行贖回要求的責任。此外，流動性管理政策包括於正常及特殊市場情況下基金經理為管理子基金的流動性風險而定期進行的壓力測試的細節。」

## 2. 託管風險

在基金認購章程「風險因素」一節下，於第 36 至 37 頁緊接於風險因素「(ff) 與 AXP 投資（如有）相關的風險」後加入以下的風險因素：

### 「(gg) 託管風險

保管人或副保管人可能為保管在當地市場的資產的目的於當地市場被委任。若子基金投資於保管及／或結算系統未完善發展的市場，子基金的資產可能承受託管風險。若保管人或副保管人遭清盤、破產或無力償債，子基金可能需要較長時間收回其資產。在極端的情況下，例如具追溯效力的法例應用及欺詐或擁有權註冊不當，子基金甚至有可能無法收回其所有資產。子基金投資於及持有該等市場的投資所承擔的成本一般較有組織的證券市場為高。」

### 3. 槓桿水平

在基金認購章程「投資及借款限制」一節下，於第 39 至 40 頁緊接於「借款限制」分節後加入以下新分節：

#### 「槓桿水平

子基金的預期最高槓桿水平如下：

基金經理須遵守上文「借款限制」分節下有關於子基金的借款限制。

基金經理不會就子基金為非對沖用途投資於金融衍生工具。因此，預期子基金不會因運用金融衍生工具而產生任何槓桿。」

### 4. 子基金的管理及行政

在基金認購章程「管理及行政」一節下，於第 40 頁「基金經理和上市代理人」分節下的第一及第二段被刪除及被以下段落取代：

「中銀國際英國保誠資產管理有限公司是子基金的基金經理和上市代理人。基金經理是中銀國際資產管理有限公司與 Prudential Corporation Holdings Limited 成立的合營企業。中銀國際資產管理有限公司是中銀國際控股有限公司的全資附屬公司，而中銀國際控股有限公司是中國銀行股份有限公司的全資附屬公司。基金經理專門從事以證券為基礎的投資組合管理業務。基金經理與具備投資專業知識的精英份子協同工作，致力於向客戶提供先進及高質素的服務，並承諾作為一家專業、審慎及可靠的基金管理機構。

基金經理持有香港證監會頒發的牌照可進行《證券及期貨條例》第 116(1)條下第一類（證券交易）、第四類（就證券提供意見）、第五類（就期貨合約提供意見）、第六類（就機構融資提供意見）和第九類（提供資產管理）受規管活動。就第一類受規管活動而言，基金經理只可從事推銷及分銷活動及只可為基金經理所管理的帳戶及集體投資計劃提供服務。就第六類受規管活動而言，基金經理只可以擔任作為其所管理的追蹤指數交易所買賣基金的上市代理人。基金經理在作為該代理人時，不得就任何涉及《企業融資顧問操守準則》所述明的首次公開招股上市計劃提供意見。此外，就第六類受規管活動而言，基金經理不得就要求將任何證券在認可證券市場上市的申請以保薦人身分行事。此外，在其所管理的追蹤指數交易所買賣基金上市之前，基金經理如就該等基金履行任何分銷職能，須嚴格遵守就標智 ETFs 系列而採納的分銷程序。」

### 5. 在基金認購章程的附件一「中國 A 股市場」內，

- (i) 於第72頁「上海證券交易所」一節下的段落下的最後一句作出修訂及重新述明如下：

「截至2018年11月1日，上海證券交易所總共有1490家上市公司，股份市價總值約為人民幣279,000億元。」

- (ii) 於第73頁「深圳證券交易所」一節下的段落下的最後一句作出修訂及重新述明如下：

「截至2018年11月1日，深圳證券交易所總共有2127家上市公司，股份市價總值約為人民幣169,500億元。」

6. 在基金認購章程的附件三「滬深300指數（「CSI 300」）」內，

- (i) 於第81頁的第一段落的第二句作出修訂及重新述明如下：

「截止2018年11月1日，該等成分股估計均在深圳證券交易所及／或上海證券交易所上市及佔滬深市場56.50%左右的市值。」

- (ii) 於第82頁「1. 基本情況」一節下的「十(10)隻最大成分股」分節內的第一段落作出修訂及重新述明如下：

「於2018年11月1日，CSI 300的（在300隻成分股份中）十(10)隻最大成分股及其各自的比重為如下：

股票代碼	股票名稱	CSI 300的百分比
601318	中國平安保險(集團)股份有限公司	7.20%
600036	招商銀行股份有限公司	3.10%
600519	貴州茅台股份有限公司	2.93%
601166	興業銀行股份有限公司	2.05%
000651	珠海格力電器股份有限公司	1.93%
600016	中國民生銀行股份有限公司	1.85%
000333	美的集團股份有限公司	1.84%
601328	交通銀行股份有限公司	1.68%
601288	中國農業銀行股份有限公司	1.51%
600276	江蘇恆瑞醫藥股份有限公司	1.43%

」

基金認購章程僅可連同本補充文件一併派發。

二零一八年十一月六日