

**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，閣下應諮詢閣下的股票經紀、銀行經理、律師、會計師或其他專業顧問。

**標智納斯達克中國新經濟公司海外 50 指數基金**  
**（將更名為「標智納斯達克中國新經濟公司 ESG 指數基金」）**  
**W.I.S.E. – Nasdaq Overseas China New Economy Companies**  
**Top 50 Index Tracker (to be renamed as “W.I.S.E. – Nasdaq**  
**China New Economy Companies ESG Index Tracker”)**  
**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：03182）**

**公 佈**  
**變更相關指數的名稱及指數編製方法，**  
**變更子基金的名稱、投資目標及政策、**  
**投資策略及重新分類子基金為 ESG 基金以及**  
**基金認購章程及產品資料概要之其他更新**

基金經理特此公佈，自二零二四年五月二十日起，子基金相關指數的指數編制方法（「指數編制方法」）將作出若干變更，且相關指數將被重新命名。子基金的名稱將變更為「標智納斯達克中國新經濟公司 ESG 指數基金」，子基金的投資目標及政策和投資策略將作出相應修訂，以反映該等變更。子基金亦將重新分類為環境、社會及管治（ESG）基金（「ESG 基金」）。此外，子基金的基金認購章程（「基金認購章程」）及產品資料概要（「產品資料概要」）將作出更新。

## 1. 相關指數的名稱及指數編製方法之變更以及子基金的名稱變更

基金經理特此通知投資者，自二零二四年五月二十日起（「生效日期」），相關指數的名稱及指數編製方法將作出修改。主要的變更及該等變更的原因／理據如下：

- (i) 相關指數的名稱將由「納斯達克中國新經濟公司海外 50 指數<sup>SM</sup>」變更為「納斯達克中國新經濟公司 50 ESG<sup>TM</sup> 指數」，以反映已納入環境、社會及管治（「ESG」）準則及考慮因素；
- (ii) 符合相關指數候選資格的證券種類將修訂為僅包括普通股。預託證券（美國及環球預託證券）及存託股票（統稱為「ADR」）將被刪除，以降低波動性的相關風險。

因此，候選資格準則將變更為僅包括在指數重組參考日期（即上月底，除非另有說明）於聯交所上市並獲納入納斯達克環球指數（NQGI）的證券，以反映該等刪除；

- (iii) 鑒於 ESG 投資已成為全球趨勢，成分證券的選取及加權過程將加入若干 ESG 準則及考慮因素，以滿足市場對 ESG 投資日益增長的需求；以及
- (iv) 為反映相關指數的變更及子基金重新分類為 ESG 基金，

(a) 子基金的名稱將更改如下：

原有名稱： 標智納斯達克中國新經濟公司海外 50 指數基金  
W.I.S.E. – Nasdaq Overseas China New Economy Companies  
Top 50 Index Tracker

新名稱： 標智納斯達克中國新經濟公司 ESG 指數基金  
W.I.S.E. – Nasdaq China New Economy Companies ESG Index  
Tracker

(b) 子基金的股票簡稱亦將由「標智新經濟 50」更改為「標智新經濟 ESG」（中文）及由「WISE NEW ECON50」更改為「WISE NEWECONESG」（英文）。

## 2. 對子基金的特點及適用風險的影響，包括投資目標及政策、投資策略之變更及子基金重新分類為 ESG 基金

基於上述變更，載列與相關指數資料有關之披露的產品資料概要及基金認購章程的相關部分（即「定義」和「子基金的主要資訊」章節），以及基金認購章程附件一將作出修訂，以反映上述變更。

此外，基金認購章程「子基金投資目標及政策」一節的首段將修訂如下，以反映指數編製方法之變更：

<p><b>修訂前</b></p>	<p>子基金是一個跟蹤指數基金，旨在跟蹤相關指數之表現。為達至子基金的投資目標，子基金將投資於由基金經理挑選的指數證券構成的一個代表性樣本。在基金經理認為適當的情況下，子基金亦可投資於非指數證券的證券。相關指數是一個由 50 隻在納斯達克 (Nasdaq)、紐約證券交易所 (NYSE) (紐交所)、NYSE American 或芝加哥期權交易所 (CBOE) 上市的成分證券組成的多元化指數，或是屬納斯達克環球指數 (NQGI) 的組成之一並在聯交所上市的成分股，包括但不限於透過美國預託證券 (「ADR」) 在美國買賣的股本證券。相關指數並沒有 A 股。相關指數由 Nasdaq, Inc. 或其附屬公司或聯繫公司 (「納斯達克」) 編製及管理。納斯達克已根據一項與基金經理訂立之指數特許權協議，以特許權方式授予基金經理權利，以就運作、營銷及推廣子基金使用相關指數。關於相關指數的詳情列於附件一。</p>
<p><b>修訂後 (自生效日期起生效)</b></p>	<p>子基金是一個跟蹤指數基金，旨在跟蹤相關指數之表現。</p> <p>子基金主要投資 (不少於其資產淨值的 70%) 於與其環境、社會及管治 (「ESG」) 焦點相符的指數證券。相關指數由 50 隻在聯交所上市並獲納入納斯達克環球指數 (NQGI) 的成分證券組成。相關指數的成分證券必須符合 (其中包括) 若干 ESG 準則，該等準則在附件一詳述。相關指數並沒有 A 股。</p> <p>相關指數由 Nasdaq, Inc. 或其附屬公司或聯繫公司 (「納斯達克」) 編製及管理。納斯達克已根據一項與基金經理訂立之指數特許權協議，以特許權方式授予基金經理權利，以就運作、營銷及推廣子基金使用相關指數。關於相關指數的詳情列於附件一。</p>

另外，子基金所採用的投資策略 (「**投資策略**」) 將由代表性抽樣策略更改為全面複製策略，以求達致子基金經更新的投資目標及政策。基金認購章程「子基金的投資策略」一節下的「子基金所採用的投資策略」分節將修訂如下：

<p><b>修訂前</b></p>	<p>基金經理擬為子基金採用代表性抽樣策略，此策略沒有全面複製相關指數的指數證券的確實比重。因此，子基金或未不時持有所有指數證券。此外，子基金可於獨立於基金經理之情況下不時持有非成分股之證券，包括倘若成分證券之買賣暫停、成分證券的企業行動導致持有有關證券或投資組合預期或應對相關指數之重新調整而正進行重新調整。基金經理可將若干指數證券的比重增加，比有關指數證券在相關指數各自的比重為高，但條件是任何指數證券的最高額外比重在正常情況下將不超過百分之四 (4%) 或將不超過基金經理在諮詢證監會之後所釐定的其他百分比。任何未有遵守上述上限的情況將在傘子基金的年報和中期報告裏披露。投資者應注意，代表性抽樣策略帶有若干額外風險，尤其是可能增加轉換時的跟蹤誤差及可能整體地增加跟蹤誤差。因此，投資者應</p>
-------------------	--

	仔細閱讀下文「風險因素」一節。
修訂後 (自生效日期起生效)	<p>為求實現子基金的投資目標，基金經理將主要採用全面複製策略，透過投資於全部或大致上全部指數證券，而投資比例與指數證券各自的比重大致相同。在下列情況下，基金經理可投資於未被納入相關指數的其他證券：(i) 若原有成分證券因任何原因不可交易，包括成分證券暫停交易，或若有關持倉是由成分證券的公司行動引致，則可使用其他證券作為替代；(ii) 預期或為應對相關指數進行重新調整，子基金在每次指數重新調整前後的短暫過渡期內，可持有經更新指數組合的新成分證券或早前指數組合的現有成分證券。</p> <p>若基於各項限制或因供應有限而無法認購作為指數證券的若干證券，在基金經理絕對酌情認為適當的情況下，基金經理亦可採用代表性抽樣策略。換言之，子基金將直接投資於具代表性的抽樣證券，這些證券的整體投資概況旨在反映相關指數的概況。具代表性的抽樣證券本身可能是指數證券，也可能不是指數證券，前提是投資組合須密切反映相關指數的整體特徵。</p> <p>投資者應注意，若採用全面複製策略缺乏效率或不可行，或在基金經理認為合適的情況下，如為投資者的利益而盡可能密切（或有效）跟蹤相關指數以實現子基金的投資目標，基金經理可絕對酌情決定採用代表性抽樣策略，毋須另行通知，而該策略不涉及按比例全面複製指數證券在相關指數中的確實比重。</p> <p>在採用代表性抽樣策略時，基金經理對若干指數證券可能會持相對其在相關指數各自比重為偏高或偏低的比重，前提是任何指數證券的比重與其在相關指數的比重之間的最大偏差在正常情況下將不會超過百分之三（3%），或將不超過基金經理在諮詢證監會後所釐定的其他百分比。任何未有遵守上述限制的情況將在子基金的年報和中期報告內披露。投資者應注意，代表性抽樣策略涉及若干額外風險，尤其是可能增加轉換時的跟蹤誤差及可能整體地增加跟蹤誤差。因此，投資者應仔細閱讀下文「風險因素」一節。</p>

基金認購章程之相關部分亦將作出修訂，包括「給投資者的重要資料」、「定義」及「投資及借款限制」章節，以反映投資策略之變更。

基金經理將於生效日期或前後重新調整子基金的投資組合，以反映相關指數組成的任何變動及投資策略之變更。建議對子基金的投資組合進行的重新調整將不會對市場造成任何重大影響，且該等變更不會干擾子基金於生效日期或前後的正常運作。

基金認購章程「風險因素」一節下的風險披露亦將相應加強及／或作出修訂，包括加入新風險因素「ESG 投資政策風險」和「代表性抽樣風險」（若基於各項限制或因供應有限而無法認購作為指數證券的若干證券而採用代表性抽樣策略），以及刪除若干風險因素，如「ADR 風險」和「交易差異風險」。

由於相關指數的股票選取過程加入 ESG 準則及考慮因素和子基金重新分類為 ESG 基金，投資者應注意以下新增風險因素：

### **ESG 投資政策風險**

在建構相關指數時考慮 ESG 因素，可能會影響子基金的投資表現，因此，與不考慮該等 ESG 因素的同類基金相比，子基金的表現可能有所不同。在相關指數的編製方法中運用以 ESG 為本的排除準則，可能會導致相關指數排除一些原本有利子基金投資的證券。另亦存在以下風險：獲指數提供者根據 ESG 準則選入相關指數的指數證券之表現可能普遍遜於整體股市，或獲指數提供者根據 ESG 準則選取的特定指數證券之表現總體可能落後於其他 ESG 基金的回報。與其他具有類似投資目標相若但不採用類同（或任何）ESG 因素的投資組合相比，相關指數（以至子基金的投資組合）的表現可能較為遜色。

子基金的投資可能集中於著重 ESG 的公司，故其價值可能比投資組合較多元化的基金更為波動。相關指數亦可不時集中於特定市場領域的證券，從而令子基金就該領域相應承受較高的風險。

根據 ESG 準則評估納入相關指數的證券及／或其比重時，指數提供者可能會依賴本身或由第三方數據提供者提供的資料和數據。該等資料和數據可能涉及定性因素，故可能令相關 ESG 準則未被正確應用。有關資料及／或數據可能偶爾不完整、不準確及不可用，或會影響指數提供者評估潛在成分證券以納入相關指數及／或從中排除的能力。與相關指數有關的 ESG 準則將根據指數編製方法，在指數審查或重新調整時或在特定參考日期進行檢視。取得數據的日期與數據用作進行審查、重新調整或評估的日期之間亦可能存有時間差距，或會影響數據的適時性及質素。因此，根據該等資料或數據評估指數證券或發行人存在風險。概無法保證指數提供者根據該等資料或數據進行的評估將反映實際情況。此外，存在若干指數證券的 ESG 表現可能會隨時間下跌，但仍留在相關指數及子基金內直至指數提供者進行下一次審查或重新調整之風險。該等指數證券或須於下一次重新調整時從相關指數及子基金的投資組合中剔除，以反映該等變動。此舉未必對子基金有利，甚至可能對子基金的表現產生不利影響。

目前尚未有公認的原則或因素可供考慮，以確保投資符合 ESG 準則。ESG 投資策略缺乏共同標準可能導致制定和達致 ESG 目標的方法有所不同。因此，指數提供者所選取的指數證券可能無法反映任何特定投資者的信念及標準，亦可能無法展現有利的 ESG 結果。

此外，由於缺乏與 ESG 投資策略相關的標準化分類法。各基金就相關 ESG 準則或因素而採用的披露標準可能有所不同。

產品資料概要亦將作出修訂，以反映上述的相關變更。

另外，基金認購章程及產品資料概要將作出若干其他輕微修訂。

上述所有變更將自生效日期起生效。

此外，載於基金認購章程附件一及產品資料概要有關相關指數的總市值之資料將作出更新。產品資料概要將於生效日期起開始提供。

實施上述變更後，有關管理子基金的費用水平／成本將不會有任何變動。因上述變更而招致的有關成本及開支將由基金經理承擔。

除本公佈所披露者外，(i)子基金的運作及／或管理方式；及(ii)子基金的其他特徵將無任何重大變動。另外，基金經理認為(i)子基金的整體風險概況於上述變更後不會有重大變動或增加；及(ii)概無任何事項／影響將會對現有投資者的權利或利益帶來重大損害。

本公佈所述變更毋須單位持有人通過，且已獲得證監會批准。

最新基金認購章程（已整合先前補充文件的修訂）及最新產品資料概要可自生效日期起於香港交易及結算所有限公司的網頁<sup>1</sup>（<http://www.hkex.com.hk>）及基金經理的網頁<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。子基金銷售文件的印刷本亦可在基金經理辦事處免費索取及／或查閱，地址為香港中環花園道 1 號中銀大廈 27 樓。

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，請按上述地址聯絡基金經理，或可致電基金經理的查詢熱線 (852) 2280 8697。

二零二四年四月十九日

---

<sup>1</sup> 此網頁並未經證監會審閱。