

恒生投資指數基金系列
(「信託」)

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)
(「附屬基金」)

公告

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意見。

如沒有特別說明，本文件中所用詞彙與信託及附屬基金的香港銷售文件所定義的有著相同涵義。

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，應詳細閱讀有關信託及附屬基金之香港銷售文件（包括相關附屬基金之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附屬基金作出推介或認許，亦不是對附屬基金的商業利弊或表現作出保證，更不代表附屬基金適合所有投資者，或認許附屬基金適合任何個別投資者或任何類別的投資者。

致各單位持有人

證券借出交易

我們作為附屬基金之基金經理，現通知閣下，由 2025 年 12 月 8 日（「生效日期」）起，以下 A 部份所述的變更將適用於附屬基金。

A. 增加附屬基金從事證券借出交易之靈活性

基金經理已決定修訂附屬基金之投資政策，以規定附屬基金可訂立證券借出交易，最高水平可達資產淨值的 10%，而預期水平可達 10%。

從事證券借出交易的原因及裨益

為附屬基金產生額外的收入，基金經理將證券借出交易納入附屬基金之投資策略。

在證券借出交易下，附屬基金按約定費用將其證券借給證券借入的交易對手，而該交易對手須承諾將在未來指定日期或應附屬基金要求歸還同等證券。

證券借出交易產生的所有收入，經扣除就證券借出交易所提供的服務而作為合理及正常薪酬的直接及間接開支後，應退回予附屬基金。

請注意，附屬基金訂立證券借出交易的水平將取決於所持有資產及交易對手的需求。無法保證附屬基金將從事證券借出交易，若有參與，亦不保證其參與程度，惟以附屬基金投資策略中規定之最高水平為限。

與證券借出交易有關的風險

由於上述變更，附屬基金將面臨與證券借出交易有關的風險。從事證券借出交易將帶來涉及交易對手的信貸風險。為緩解此風險，交易對手須提供最少達借出證券估值 100% 的抵押品，而抵押品

須每日按市價估值。附屬基金收取的抵押品將須遵循交易對手政策及抵押品政策。

然而，交易對手可能無法於到期時歸還證券或無法按要求提供額外抵押品。若交易對手發生此類違約事件，且抵押品價值跌至低於借出證券的價值，可能導致附屬基金資產淨值減少。

附屬基金亦須承受證券借出代理人的營運風險（例如結算錯誤、抵押品管理）和抵禦能力風險（例如在遇到突發事件時仍可維持營運的能力）。上述延誤及中斷可能限制附屬基金根據贖回要求履行交付或付款責任的能力。

附屬基金的香港銷售文件及產品資料概要中的風險披露將相應更新。投資者在作出任何投資決定前，應詳細閱讀有關信託及附屬基金之香港銷售文件（包括相關附屬基金之產品資料概要及當中所載之風險因素之全文）。

B. 對附屬基金的影響

該等變動不會導致附屬基金的整體風險狀況出現重大變更；及該等變動不會嚴重損害單位持有人的權利及利益。

C. 附屬基金的基金說明書及條款單張之修訂

附屬基金的香港銷售文件及產品資料概要將作出修訂，以反映上述 **A** 部份之變更。已更新的附屬基金的香港銷售文件及產品資料概要，可於生效日期起在基金經理的網站 www.hangsenginvestment.com（此網站內容未經證監會審核）及香港交易及結算所有限公司的網站 www.hkex.com.hk（此網站內容未經證監會審核）瀏覽。

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
2025 年 11 月 7 日