

本公告乃重要文件，敬希即時垂注。如對本公告有任何疑問，應諮詢閣下的股票經紀、銀行經理、律師、專業會計師或其他專業顧問。

香港聯合交易所有限公司、香港中央結算有限公司及香港證券及期貨事務監察委員會對本公告的內容概不負責，亦不對其準確性或完整性作出任何申述，並且明確地拒絕就由於或依賴本公告的全部或任何部分內容所引起的任何損失承擔任何責任。

# db x-trackers\*

(「本公司」)

(\*此傘子基金包含合成交交易所買賣基金)

可變資本投資公司

註冊辦事處：49, avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg,

盧森堡商業及公司註冊處編號 B-119.899

---

db x-trackers MSCI 俄羅斯權重上限指數 UCITS ETF\* (證券編碼：3027)

(「附屬基金」)

(\*此基金為合成交交易所買賣基金)

---

## 致香港股東之公告

---

### 各香港股東：

除非本公告另行界定，本公告的用詞應具有本公司 2017 年 4 月 28 日之香港發行章程(「香港發行章程」)規定的相同涵義。

董事會謹此敬告各股東，附屬基金 2017 年 4 月 28 日的產品附件及產品資料概要中有關參考指數的指數計算方法說明的披露資料已作出一些修正。

作為背景資料，管理公司於 2016 年 7 月對附屬基金參考指數的指數計算方法披露資料進行了檢討。由於人為的錯誤，在檢討過程中採用了不正確的指數說明，導致不正確地修改了指數計算方法內有關參考指數所設有的權重上限機制的說明。不正確的披露資料首次出現於日期為 2016 年 9 月 14 日的附屬基金產品附件。

現有不正確的披露資料以及修正後的披露資料列明如下：

	產品附件的現有披露資料	修正後的產品附件披露資料
在「投資目標及政策」一節之下	參考指數於每季檢討及重新調整(於季度指數檢討時，「 <b>季度檢討</b> 」)，亦可在其他時間重新調整，以反映諸如合併及收購等公司活動。於每個重新調整日，最大成分股的比重上限設定於參考指數的總公眾持股量市值的 <b>30%</b> ，而參考指數第二大成分股的比	參考指數於每季檢討及重新調整(於季度指數檢討時，「 <b>季度檢討</b> 」)，亦可在其他時間重新調整，以反映諸如合併及收購等公司活動。於每個季度重新調整日，最大成分股的比重上限設定於參考指數的總公眾持股量市值的 <b>30%</b> ，而參考指數第二大成分股的比

	<p>重上限設定於參考指數的總公眾持股量市值的 <b>20%</b>。此外，按每日計，如參考指數成分股的比重超過 <b>35%</b>，其上限將設定於 <b>30%</b>，在設定此上限後，餘下成分股的比重將設定於 <b>20%</b>。如沒有發行人的比重超過每日或季度檢討限額，則所有發行人將按照其在母參考指數的公眾持股量調整市值加權，即大約為俄羅斯可投資股票範圍的 <b>85% (+/- 5%)</b>。</p>	<p><u>重</u>上限設定於參考指數的總公眾持股量市值的 <del>20%</del>母參考指數中比重超過 <u>25%</u>的任何發行人的權重上限將設定於 <b>20%</b>。餘下未設上限的權重將按比例重新分配予參考指數的所有餘下發行人。此外，按每日計，如參考指數成分股發行人的比重超過 <del>35</del><u>25%</u>，其上限將設定於 <del>30</del><u>20%</u>，在設定此上限後，餘下成分股的比重將設定於 <del>20%</del>過剩的比重將按比例分配予參考指數內餘下的發行人。如沒有發行人的比重超過每日或季度檢討限額，則所有發行人將按照其在母參考指數適用於外國投資者的公眾持股量調整市值加權，即大約為俄羅斯可投資股票範圍的 <b>85% (+/- 5%)</b>。</p>
<p>在「參考指數的一般資料」一節之下</p>	<p>於每次季度指數檢討(「<b>季度檢討</b>」)開始時(一般是在三月、六月、九月和十二月的第一個營業日)，最大成分股的比重設定於參考指數的總公眾持股量市值的 <b>30%</b>，而參考指數第二大成分股的比重設定於參考指數的總公眾持股量市值的 <b>20%</b>。此外，按每日計，如參考指數成分股的比重超過 <b>35%</b>，其上限將設定於 <b>30%</b>，在設定此上限後，餘下成分股的比重將設定於 <b>20%</b>。</p>	<p>於每次季度指數檢討(「<b>季度檢討</b>」)開始時(一般是在三月、六月、九月和十二月的第一個營業日)，最大成分股的比重設定於參考指數的總公眾持股量市值的 <del>30%</del>，而參考指數第二大成分股的比重設定於參考指數的總公眾持股量市值的 <del>20%</del>母參考指數中比重超過 <u>25%</u>的任何發行人的權重上限將設定於 <b>20%</b>。餘下未設上限的權重將按比例重新分配予參考指數的所有餘下發行人。此外，按每日計，如參考指數成分股發行人的比重超過 <del>35</del><u>25%</u>，其上限將設定於 <del>30</del><u>20%</u>，在設定此上限後，餘下成分股的比重將設定於 <del>20%</del>過剩的比重將按比例分配予參考指數內餘下的發行人。</p>

在「與附屬基金有關的額外風險因素」一節之下原標題為「參考指數成分股權重上限」的有關風險因素亦已更新，修正後的標題為「發行人權重上限」。

此外，為了更清晰起見，附屬基金的相關文件中參考指數的名稱已從「MSCI 俄羅斯權重上限指數」修改為「**MSCI 俄羅斯發行人權重上限 25%指數**」，以便更清晰反映有關的權重上限設定機制。

與參考指數有關的進一步資料，於網址 <https://www.msci.com/www/index-factsheets/msci-russia-issuers-capped-25/016652158> 閱覽。

請各股東注意：

- (1) 附屬基金所追蹤的**參考指數並沒有任何變更**，仍然是產品附件所示，以彭博編碼 MSRC25NU<INDEX><GO> 辨識的 25%發行人權重上限版本的 MSCI 俄羅斯指數；
- (2) 從於日期為 2016 年 9 月 14 日的香港發行章程內刊發不正確的披露資料起至本公告之日為止的期間，不曾發生任何權重上限設定事件。因此，不正確的披露資料並沒有對附屬基金的表現帶來任何經濟上的影響，也沒有影響附屬基金的運作。

此乃單一獨立事件。為免將來發生同類事件，管理公司已在相關團隊內實行額外的檢討措施。

產品附件及產品資料概要的披露資料已作出修正，已修改的附屬基金產品附件及產品資料概要可於本公司的網址 <http://etf.deutscheam.com><sup>1</sup> 及香港交易及結算所有限公司的網址 [www.hkexnews.hk](http://www.hkexnews.hk)<sup>1</sup> 閱覽。已修改的附屬基金產品附件及產品資料概要印刷本亦可向加皇信託香港有限公司(「香港代表」)(地址為香港灣仔港灣道 18 號中環廣場 51 樓)免費索取。

本公司董事會對本公告所載資料的準確性承擔責任。

如有任何查詢，請逕向閣下的財務顧問或香港代表(電話號碼：(852) 2978 5656)提出。

**db x-trackers\*** (\*此傘子基金包含合成交易所買賣基金)  
承董事會命

2017 年 6 月 29 日

---

<sup>1</sup>此網址並未經香港證券及期貨事務監察委員會審核。