

**重要資料:**

香港交易及結算所有限公司（「香港交易所」）、香港聯合交易所有限公司（「香港聯交所」）、香港中央結算有限公司（「香港結算」）及香港證券及期貨事務監察委員會（「證監會」）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聲明，並明確表示，概不對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。

證監會的認可不是對計劃作出推介或認許，亦不是對計劃的商業利弊或表現作出保證，更不代表該計劃適合所有投資者，或認許該計劃適合任何特定投資者或類別投資者。

此乃重要文件，請即處理。倘閣下對本公告內容有任何疑問，應尋求專業意見。由於無法保證投資回報，投資涉及風險，可能導致重大損失。

管理人對本公告所載資料的準確性承擔全部責任，並於作出所有合理查詢後，確認據其所知及所信並無遺漏任何其他事實可能導致任何陳述出現誤導。

**中金基金系列（「信託」）**

**（前稱為「中金 ETF 系列」）**

*（根據香港《證券及期貨條例》（第 571 章）  
第 104 條獲認可的香港傘子單位信託）*

**中金中證優選 100 ETF**

股份代號：**83093**（人民幣櫃台）及 **03093**（港元櫃台）

**中金彭博中國國債 1-10 年 ETF**

**（前稱為「中金彭博巴克萊中國國債 1-10 年 ETF」）**

股份代號：**83079**（人民幣櫃台）及 **03079**（港元櫃台）

**工銀中金美元貨幣市場 ETF**

上市類別單位股份代號：**03011**（港元櫃台）及 **09011**（美元櫃台）

**中金香港股票基金**

股份代號：不適用

**中金港元貨幣市場 ETF**

上市類別單位股份代號：**03071**（港元櫃台）

（各自為「子基金」，統稱為「各子基金」）

各基金單位持有人：

中國國際金融香港資產管理有限公司為信託及各子基金的管理人（「管理人」），謹此通知信託及各子基金單位持有人有關各子基金的如下修訂，除非另有說明，將自 2021 年 10 月 8 日（「生效日期」）起生效。

**A. 重大計劃變更**

## 1. 對工銀中金美元貨幣市場 ETF 及中金港元貨幣市場 ETF 有關投資逆回購交易的投資策略作出的更改

目前，據銷售文件披露，(i) 工銀中金美元貨幣市場 ETF 或會將其最多 30% 的資產淨值訂立逆回購交易；及 (ii) 中金港元貨幣市場 ETF 不會訂立任何逆回購交易。

自生效日期起，為提高管理人的靈活性以更好實現上述子基金的投資目標，尤其是鑒於近期利率呈下降趨勢，管理人建議該等子基金可各自訂立逆回購交易，而該等交易的預期投資介乎其各自資產淨值的 0% 至 50%，最大不超過其各自資產淨值的 100%，惟向同一交易對手提供的現金總額不得超過各子基金各自資產淨值的 15%。管理人認為，上述子基金的單位持有人或可因此等交易產生收益令子基金表現可能加強而得益。

收取的抵押品只可以是現金及優質貨幣市場投資項目，且須符合上述子基金現有投資策略中所載列有關該等子基金可投資債務證券的信貨質素、到期日及流動性準則。抵押品連同該等子基金根據各自的投資策略而作的其他投資的加權平均到期日及加權平均期限，亦不得超過該等子基金各自現有投資策略中規定的限制。

上述子基金訂立的逆回購交易的對手方為持續受審慎監管的金融機構，且為得到管理人批准的獨立交易對手，其最低信貸評級預期為 BBB- 或以上（穆迪或標準普爾）（或是任何認可信貸評級機構的同等評級），或者為獲證監會發牌的公司，或已向香港金融管理局註冊的機構。除上述條件外，對交易對手的來源國並無要求。此類交易產生的所有收益，將扣除直接及間接開支作為在此類交易中提供服務的合理正常補償，然後撥回上述子基金。

鑒於上述投資策略的變更，工銀中金美元貨幣市場 ETF 有可能承受較高及中金港元貨幣市場 ETF 可能面臨以下風險因素：

「與逆回購交易有關的風險 – 若存放現金的對手方一旦違約，收回存放在外的現金或會受到延誤，或難以變現抵押品，或出售抵押品的所得款項可能會因抵押品的不準確定價或市場變動而少於存放於對手方的現金，因而令子基金蒙受虧損。」

## 2. 取消中金香港股票基金的單一管理費結構

目前，中金香港股票基金採用單一管理費結構，即子基金會支付其所有費用、成本及開支作為單一固定管理費。管理費每年按子基金資產淨值的 1.25% 收取。在釐定管理費時考慮的費用及開支包括但不限於管理人費用、受託人費用、註冊服務費、核數師費用及開支、證券交易費以及管理人或受託人或其代理產生的普通現金開支。自該子基金推出以來，該子基金超出上述固定費用的費用及開支一直由管理人承擔。

鑑於該子基金已推出超過 12 個月，且該子基金的基金規模和開支自推出以來一直穩定，管理人認為該子基金已經且在可預見的未來將持續具有成本效益和經濟可行性，因此建議從生效日期起改變該子基金的費用結構，取消單一管理費結構，及該子基金將收取以下費用：

- (a) 每年按其資產淨值的 1.25% 收取管理費；及
- (b) 每年按不超過其資產淨值的 1.0% 收取受託人費用，

兩項費用均每日累計，於每個交易日計算，並以港元於每月月底從子基金中撥付。

此外，註冊服務費、核數師費用及開支、證券交易費以及管理人或受託人或其代理產生的普通現金開支等其他費用和開支，亦可自該子基金另行撥付，由該子基金承擔。因此，自生效日期起，管理人將不再承擔上述子基金超出上述披露的現有固定管理費的任何費用和開支。

變更之後，該子基金每年應付的費用和開支可能超過該子基金資產淨值的 1.25%，管理人估計該子基金一年內的經常性開支數字將為其資產淨值的 1.60%。該數字是管理人對 12 個月期間預計經常性開支總和作出的最佳估算，並以同期 12 個月期間預計平均資產淨值的某個百分率表示。

### 3. 相關變更的影響

除本公告 A 部分第 1 節和第 2 節所載的變動外，工銀中金美元貨幣市場 ETF、中金港元貨幣市場 ETF 和中金香港股票基金的現有運作或管理方式均不會發生變化。這些變化不會對現有單位持有人的權利或利益造成重大損害。

除上述本公告 A 部分第 2 節所載的變動外，於實施上述變動後，各子基金應付的費用水平不會發生變化。

### 4. 成本

因本公告 A 部分第 1 節所述變更所產生的成本及／或費用約為 80,000 港元，將由工銀中金美元貨幣市場 ETF 和中金港元貨幣市場 ETF 按其各自資產淨值比例承擔。

因本公告 A 部分第 2 節所述變更所產生的成本及／或費用約為 100,000 港元，將由中金香港股票基金承擔。

### 5. 單位持有人的選擇

工銀中金美元貨幣市場 ETF 和中金港元貨幣市場 ETF 上市類別單位的單位持有人可於香港聯交所交易時段內，按照通常交易安排，在香港聯交所出售其基金單位。

由於工銀中金美元貨幣市場 ETF、中金港元貨幣市場 ETF 及中金香港股票基金的非上市類別單位現時不收取任何贖回費用，其單位持有人可根據信託及各子基金的基金說明書（「**基金說明書**」）所載的贖回程序，於生效日期前隨時免費贖回其投資。

## **B. 非重大變更、澄清及加強披露**

### **1. 變更工銀中金美元貨幣市場 ETF 及中金港元貨幣市場 ETF 的投資策略，以使該等子基金可投資於其他貨幣市場基金**

目前，根據工銀中金美元貨幣市場 ETF 和中金港元貨幣市場 ETF 的投資策略所披露，該等子基金不會投資於其他集體投資計劃。

經考慮現行市況後，管理人希望提高貨幣市場基金投資的靈活性，建議自本公告日期起，上述各子基金最多可將其資產淨值的 10% 投資於其他證監會認可<sup>1</sup>的貨幣市場基金。

## 2. 有關工銀中金美元貨幣市場 ETF 涉及非美元計價及結算的投資策略澄清

工銀中金美元貨幣市場 ETF 藉著主要投資（即不低於其資產淨值的 70%）於美元計價及結算的短期存款以及由政府、準政府、國際組織及金融機構發行的優質貨幣市場投資項目，尋求按現行貨幣市場利率計算的美元回報，主要的考量為資本保值及流動性。

自本公告日期起，投資策略將會修訂，以使工銀中金美元貨幣市場 ETF 亦可將少於其資產淨值的 30% 投資於非美元計價及結算的短期存款及優質貨幣市場投資項目。管理人可將任何非美元計價及結算的投資與美元對沖，以管理任何重大貨幣風險。

## 3. 有關工銀中金美元貨幣市場 ETF 及中金港元貨幣市場 ETF 所投資債務證券信貸質素的澄清

目前，據披露，工銀中金美元貨幣市場 ETF 和中金港元貨幣市場 ETF 會投資於由獨立評級機構（例如惠譽、穆迪及標準普爾）評定為投資級別或以上的債務證券。就此而言，如相關債務證券本身並無信貸評級，則可參考此類債務證券之發行人的信貸評級。

謹此自本公告日期起澄清，在投資債務證券時，如相關債務證券本身並無信貸評級，則可參考此類債務證券之發行人或擔保人的信貸評級。

## 4. 延長申請認購中金香港股票基金非上市類別單位的交易截止時間及清算資金截止時間

目前，中金香港股票基金非上市類別單位的交易截止時間為每個交易日中午十二時正（香港時間），且認購此等單位的投資者須於提交認購申請的交易日當日中午十二時正（香港時間）（即清算資金截止時間）或之前，就此等單位以經清算資金支付全數款項。倘於緊接此等單位款項到期的交易日後的交易日並未接獲全數清算資金款項，則管理人（在不損害因申請人並未於該下一交易日支付到期款項而提出任何申索的權利的情況下）可全權酌情決定拒絕該申請，且不會就該申請發行單位。

自 2021 年 9 月 17 日起，交易截止時間將延長至每個交易日的下午四時正（香港時間），而清算資金截止時間亦將延長至提交認購申請的交易日的下午四時正（香港時間），除非管理人另行同意，否則認購款項的經清算資金須於該清算資金截止時間前收訖。該子基金可依據於交易日收到的申請，根據投資者作出的該等申請指令向投資者發行單位，並投資預期的申請金額。在任何情況下，倘付款未於相關交易日後的三個營業日內或管理人釐定並向相關申請人通知的其他時間內結算，則管理人保留權利（在不損害因申請人並未支付到期款項而提出任何申索的權利的情況下）取消交易。

申請取消後，相關非上市類別單位將被視為從未發行，且申請人無權就此向管理人或受託人提出申索，惟：(i) 註銷該等非上市類別單位不會導致該子基金先前的估值須重新評估或無效；(ii) 管理人及受託人可要求申請人支付註銷費，金額相等於處理該申請人有關該等非上市類別單位的申請所涉及的行政費用；及(iii) 管理人及受託人可要求申請人支付（就每個據此被註銷的非上市類別單位向該子基金支付）相等於每個該等非上市類別單位的認購價超出於註銷當日（如該

<sup>1</sup> 證監會的認可不是對計劃作出推介或認許，亦不是對計劃的商業利弊或表現作出保證，更不代表該計劃適合所有投資者，或認許該計劃適合任何特定投資者或類別投資者。

日是相關非上市類別的交易日)或緊接交易日當日該非上市類別單位贖回價值的金額(如有)加上該金額的利息,直至受託人收訖此項付款。

## 5. 有關中金香港股票基金投資中國內地市場證券的投資策略的闡述

根據目前所披露,中金香港股票基金對在香港境外發行或交易的證券的投資總額將低於該子基金資產淨值的 30%。該等證券包括但不限於股票(即倘為中國 A 股,透過滬港通及深港通投資及/或透過融資掉期交易或連接產品(如中國 A 股連接產品)或投資於中國 A 股的基金間接投資)。

自本公告日期起,該子基金的投資策略將修訂,披露其對在中國內地市場發行證券的直接及間接投資總額將不超過其資產淨值的 20%,其中包括但不限於中國 A 股和其他適用的中國內地法規批准的金融工具。

## 6. 其他更新

基金說明書及相關子基金的產品資料概要(若適用)亦將更新,以反映其他行政、雜項及編輯方面的修訂,其中包括但不限於以下項目:

- 更新相關子基金的指數資料、參與證券商和莊家名單;及
- 插入有關中金香港股票基金增設 R 類別(人民幣)單位的披露,該等單位將於獲得中國證監會相關批准根據內地與香港基金互認安排於中國內地分銷後,僅向中國內地投資者發售,供彼等認購。為免生疑問,該單位類別不會在香港銷售。

## 7. 變更的影響

就本公告 B 部分上文第 1 至 5 節所述的變動,管理人認為:

- 該等變動不構成工銀中金美元貨幣市場 ETF、中金香港股票基金及中金港元貨幣市場 ETF 的重大變動;
- 該等變動不會嚴重改變或增加工銀中金美元貨幣市場 ETF、中金香港股票基金和中金港元貨幣市場 ETF 的整體風險狀況;及
- 變更不會對單位持有人的權利或利益(包括單位持有人行使權利的能力)產生重大不利影響。

## C. 一般資料

除另有說明外,本公告內的詞彙與基金說明書所界定者具有相同涵義。

上述變動將於經修訂的基金說明書及有關子基金的產品資料概要(若適用)內反映。經修訂基金說明書及產品資料概要將於生效日期或前後刊載於管理人的網站 [www.cicc.com](http://www.cicc.com)(該網站未經證監會審核)及香港聯交所網站 [www.hkex.com.hk](http://www.hkex.com.hk)。信託契據亦會透過補充契據方式修訂以訂明相關變更。經修訂的信託契據副本將可於任何日子(星期六、日及公眾假期除外)的日常辦公時間內隨時在管理人辦事處(見下文地址)供免費查閱。

倘閣下有任何疑問或需要本公告任何方面的進一步資料，請於日常辦公時間內親臨香港中環港景街 1 號國際金融中心一期 29 樓或致電+852 2872-2000 與管理人聯絡。

**中國國際金融香港資產管理有限公司**  
作為信託及各子基金的管理人

2021 年 9 月 8 日