

重要资料: 本公告为重要文件, 敬请即时关注。如投资者对本公告的内容有任何疑问, 请咨询独立专业财务意见。

关于惠理价值基金修改基金文件的公告

除非本公告另有注明, 本公告所使用的术语应具有惠理价值基金(“本基金”)适用于内地销售的 2019 年 7 月版《惠理价值基金招募说明书》(“《招募说明书》”)所界定的相同涵义。

本公告旨在告知内地投资者, 本基金将作出以下变更, 有关变更将自 2020 年 1 月 1 日(“生效日期”)起生效。

一、 根据修订版《单位信托及互惠基金守则》作出的变更

本基金须遵守香港证券及期货事务监察委员会(“香港证监会”)颁布的《单位信托及互惠基金守则》(“《单位信托守则》”)。《单位信托守则》已经修订。本基金的《信托契约》将进行修订及重述, 且《招募说明书》将进行修订(“修订版《招募说明书》”), 以反映修订版《单位信托守则》的要求。

《信托契约》及/或《招募说明书》(如适用)将作出以下主要变更(“变更”), 以反映修订版《单位信托守则》的规定及/或其所赋予的灵活性:

1. 受托人及基金管理人 – 根据修订版《单位信托守则》第 4 章及第 5 章的规定补充受托人及基金管理人的额外职责。
2. 投资限制: 核心规定 – 根据修订版《单位信托守则》第 7 章对投资限制及禁止的核心要求进行修订, 包括但不限于与以下内容有关的修订: 投资分布、投资商品的限制、借出贷款的限制、借入款项的限额、金融衍生工具、证券融资交易及担保物等。

按照修订版《单位信托守则》对投资限制/要求进行的主要修订的概要载于本公告的附件 A。

3. 巨额赎回限额 – 为实现修订版《单位信托守则》所赋予的灵活性, 《信托契约》将进行修订, 以允许按本基金的总资产净值或已发行份额总数(由基金管理

人决定), 而并非只按已发行份额总数对本基金施加赎回限额。自生效日期起, 基金管理人可按本基金的总资产净值(而非按已发行份额总数)施加赎回限额。尤其是, 基金管理人可将在任何交易日赎回的本基金所有类别的份额总数限定为本基金总资产净值的 10%。

4. 其他修订 – 为反映修订版《单位信托守则》的规定而进行的其他修订及强化披露的内容, 包括但不限于以下内容:

- (1) 保管安排 – 强化有关保管安排的披露。
- (2) 未领款项 – 就当本基金终止时处理基金份额持有人未领款项的安排进行额外披露。
- (3) 与关联人士的交易 – 根据修订版《单位信托守则》中对于与关联人士进行交易及非金钱利益安排的规定进行的修订。
- (4) 证券借贷交易 – 强化有关证券借贷交易的披露, 包括对手方的标准及受制于该等交易的资产的托管/安全保管安排。此外, 此前从任何证券借贷安排获得的任何额外收益可由本基金及任何证券借贷代理人按基金管理人根据各种情况可能决定的比例分摊, 但是向任何证券借贷代理人应付的款项不应超过该额外收益的 30%。以后所有因证券借贷交易而产生的收入在扣除作为就证券借贷交易所提供服务的合理正常补偿的直接及间接开支后, 将退还本基金。
- (5) 担保物政策 – 强化有关本基金担保物政策的披露, 包括本基金持有的担保物的选择标准、性质及政策, 以及所持担保物的描述, 包括担保物的性质和质量、估值折扣政策、现金担保再投资政策、保管安排及与担保物管理相关的风险。

二、本基金的投资政策的修订

本基金的投资政策将进行以下修订:

1. 目前, 本基金可投资于商品。根据修订版《单位信托守则》, 除非经香港证监会另行批准, 否则本基金不得投资于实物商品。因此, 本基金的投资政策将进

行修订,以遵守修订版《单位信托守则》,因此,自生效日期起,本基金将不再投资于实物商品(除非经香港证监会的另行批准)。为免生疑问,本基金可继续投资于商品期货合约。

2. 强化披露,以表明本基金可以出于对冲及/或投资目的使用金融衍生工具,该等金融衍生工具包括但不限于期货、期权、掉期(包括但不限于信用及信用违约、股票、利率及通胀掉期)、远期外汇合约、参与票据、信用挂钩票据及任何其他金融衍生工具,但本基金的衍生工具净敞口不得超过其资产净值的 50%;及
3. 目前,在得到受托人事先书面同意的前提下,基金管理人可从本基金资产中向外发放贷款。特别是,可间接参与或附属参与目前银行对例如越南及朝鲜等国家中不履约还款的借款人作出的现有银行贷款,目的在于当有关借款人信用状况有所改善时,或对这些国家实施某种债务减免计划时从中获取利润。自生效日期起,基金管理人不得以从本基金的资产中借出任何贷款。

三、 本基金基金登记机构的变更

目前,汇丰机构信托服务(亚洲)有限公司为本基金的受托人、基金登记机构、行政管理人及保管人。自生效日期起,汇丰机构信托服务(亚洲)有限公司将不再担任本基金的基金登记机构,而 HSBC Trustee (Cayman) Limited (“新基金登记机构”)将获委任取代其担任本基金的基金登记机构。因此,本基金的基金份额持有人名册将位于香港境外。

此外,目前本基金就受托人作为本基金的基金登记机构所提供的服务而向受托人支付的基金登记机构费用为本基金资产净值的每年 0.03%,将自生效日期起应付给基金登记机构。为免生疑问,委任新基金登记机构不会导致基金登记机构费用的增加。

《招募说明书》及《基金产品资料概要》将进行相应修订,以反映本基金基金登记机构的上述变更。

四、 其他更新/修订

其他变更包括:

1. 更新《招募说明书》内基金管理人董事的履历;
2. 更新有关沪港通及深港通的披露;
3. 对《招募说明书》及《信托契约》中所载估值规则进行澄清性修订。该等澄清性修订不会使本基金资产的实际估值方式产生任何改变;
4. 更新及强化税务披露;
5. 强化与《个人资料(私隐)条例》(香港法例第 486 章)有关的披露; 及
6. 其他相应修改及杂项更新及编辑上的修订。

请参阅修订版《招募说明书》、更新版《基金产品资料概要》及更新的整合版《信托契约》，以了解进一步详情。

五、变更的影响

除在本公告中披露的事项外，上文所载变更将不会导致本基金的投资目标及风险概况有任何重大变更。该等变更不会导致应从本基金资产中支付的费用增加。该等变更也不会改变本基金目前的运作或管理方式。

六、文件查阅

现行版本的《招募说明书》及《基金产品资料概要》可在内地代理人网站 <http://www.thfund.com.cn> 查询，以及可在任何一日(星期六、星期日及公众假期除外)正常办公时间内在内地代理人的地址免费查阅，也可在支付合理工本费后索取复印件。

七、重要提示

1. 投资者在办理基金交易前，请仔细阅读登载在本基金内地代理人的网站 (www.thfund.com.cn)的本基金适用于内地销售的《招募说明书》、《产品资料概要》及《信托契约》等相关法律文件及公告，并确保遵循其规定。

2. 本基金作为香港互认基金在内地公开销售,其投资运作、风险特征、法律法规适用等与内地基金产品不同,敬请投资者认真阅读上述本基金法律文件及公告(包括当中的风险揭示内容),谨慎做出投资决策。
3. 基金管理人对本公告所载信息的准确性承担全部责任,并于作出一切合理查询后确认,就其所深知及确信,于本公告刊发日期,本公告并未遗漏任何其他事实以致本公告的任何陈述具有误导成分。

八、投资者可以通过内地代理人如下途径咨询有关情况

若投资者对上述内容有任何疑问,可通过以下方式与内地代理人联络。谨此感谢投资者一直以来的宝贵支持,并期望继续为投资者提供服务。

天弘基金管理有限公司
客服热线: 95046
网站: www.thfund.com.cn

九、风险提示

投资涉及风险(包括可能会损失投资本金),基金份额净值可升可跌,过往表现并不可作为日后表现的指引。投资前请参阅本基金适用于内地销售的《招募说明书》、《产品资料概要》及《信托契约》等相关法律文件及公告所载详情,包括投资于本基金的主要风险、对于内地投资者的特殊风险以及有关本基金作为香港互认基金的特有风险。

本基金系依据《香港互认基金管理暂行规定》经中国证券监督管理委员会注册后在内地公开销售的香港互认基金。但中国证券监督管理委员会对本基金的注册,并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

特此公告。

惠理基金管理香港有限公司

2019年11月29日

附件 A

投资及借贷限制的主要修订概要

本基金的投资限制及借贷限制的主要修订如下:

- (a) 本基金通过以下方式投资于任何单一实体或就任何单一实体承担风险的总值(政府证券及其他公共证券除外)不可超过其最近期可得资产净值的 10%:
 - (i) 对该实体发行的证券作出投资;
 - (ii) 通过金融衍生工具的底层资产就该实体承担的风险; 及
 - (iii) 因与该实体就场外金融衍生工具进行交易而产生的对手方净敞口;

- (b) 根据修订版《单位信托守则》的规定, 除非经香港证监会另行批准, 否则本基金通过以下方式投资于同一个集团内的实体(即一般而言, 为按照国际公认会计准则编制合并财务报表而被纳入同一个集团内的实体)或就同一个集团内的实体承担风险的总值不可超过其最近期可得资产净值的 20%:
 - (i) 对该等实体发行的证券作出投资;
 - (ii) 通过金融衍生工具的底层资产就该等实体承担的风险; 及
 - (iii) 因与该等实体就场外金融衍生工具进行交易而产生的对手方净敞口;

- (c) 除非经香港证监会另行批准, 否则本基金存放于同一个集团内的实体(一个或多个)的现金存款的价值不可超过其最近期可得资产净值的 20%, 但在修订版《单位信托守则》规定的特定情况下可超过该 20%的上限;

- (d) 除非香港证监会考虑有关实物商品的流动性及(如有必要)是否设有充分及适当的额外保障措施后按个案情况给予批准, 否则本基金不可投资于实物商品;

- (e) 根据修订版《单位信托守则》的规定,本基金不可借出贷款、承担债务、进行担保、背书票据,或直接地或或然地为任何人的责任或债务承担责任或因与任何人的责任或债务有关而承担责任。为免生疑问,符合修订版《单位信托守则》规定的逆回购交易不受此限;
- (f) 本基金的最高借入款项金额将从其最近期可得资产净值的 25%降至 10%。尽管本基金不打算进行销售及回购交易,但为免生疑问,符合修订版《单位信托守则》规定的销售及回购交易及证券借贷交易不受此限;
- (g) 本基金可为对冲目的而取得金融衍生工具;
- (h) 本基金根据其投资目标及政策也可为非对冲目的而取得金融衍生工具,但与该等金融衍生工具有关的净敞口(“衍生工具净敞口”)不得超过其最近期可得资产净值的 50%,且符合本公告正文第二部分第 2 点所述的条件。

下文适用于衍生工具净敞口的计算:

- (i) 在计算衍生工具净敞口时,须将本基金为投资目的而取得的金融衍生工具换算成该等金融衍生工具底层资产的对应持仓,并考虑底层资产的当前市值、对手方风险、未来市场动向及可供变现持仓的时间;及
- (ii) 衍生工具净敞口应根据香港证监会发布的规定和指引(可不时更新)进行计算。

为免生疑问,对于为对冲目的取得的金融衍生工具,只要不会因该等对冲安排产生任何剩余的衍生工具敞口,则计算上述 50%的限额时不会将该等金融衍生工具计算在内;及

- (i) 为限制就各对手方承担的风险,本基金可收取担保物,但担保物须符合修订版《单位信托守则》的规定。