

## Global X Exchange Traded Funds Series OFC – Global X 中國機械人及人工智能 ETF 2021年4月

發行人：未來資產環球投資（香港）有限公司

- 本子基金是被動式交易所買賣基金（ETF）。
- 本概要提供本子基金的重要資料。
- 本概要是基金說明書的一部分。
- 請勿單憑本概要作投資決定。

### 資料便覽

股份代號：	港元櫃台：02807 美元櫃台：09807
每手交易數量：	港元櫃台：50股 美元櫃台：50股
管理人：	未來資產環球投資（香港）有限公司
保管人：	花旗信托有限公司
行政管理人：	花旗銀行香港分行
一年內持續收費*：	預期為 0.68%
預期年追蹤偏離 <sup>^</sup> ：	-2.00%
相關指數：	FactSet 中國機械人及人工智能指數（淨總回報）
基礎貨幣：	人民幣
交易貨幣：	港元櫃台：港元 美元櫃台：美元
子基金財政年度終結日：	3月31日
派息政策：	由管理人每年酌情決定（通常於每年5月）。分派可從資本中或實際上從資本中撥付，惟倘子基金的營運成本高於管理子基金現金及持有投資產品的回報，則不可作如此分派。 所有股份（不論於港元或美元櫃台進行買賣）的分派僅以人民幣支付。
ETF 網站 <sup>#</sup> ：	<a href="https://www.globalxetfs.com.hk/">https://www.globalxetfs.com.hk/</a>

\*由於子基金（定義見下文）是新設立，此數值僅為估計值，並為12個月期間內的估計持續收費的總和，以同段時間內的估計平均資產淨值的百分比表示。此數值可能與子基金實際運作時的數值不同，每年之間亦可能有所變動。

<sup>^</sup>此乃估計的年追蹤偏離。投資者務請參閱子基金網站以獲取更多有關實際追蹤偏離的最新資訊。

<sup>#</sup>此網站並未經證監會審批。

### 子基金是甚麼產品？

- GlobalX 中國機械人及人工智能 ETF（「子基金」）是 Global X Exchange Traded Funds Series OFC（「本公司」）的子基金，其乃根據香港法例成立，具有可變動股本、有限責任且與子基金之間的法律責任分隔的公開傘子開放式基金型公司。
- 子基金是《單位信託及互惠基金守則》（「守則」）第8.6條所界定的被動式管理追蹤指數交易所買賣基金。子基金的股份（「股份」）猶如股票般於香港聯合交易所有限公司（「聯交所」）買賣。子基金以人民幣計價，增設及贖回只可使用人民幣。

## 目標及投資策略

### 目標

子基金的投資目標是提供在扣除費用及開支前與FactSet中國機械人及人工智能指數（「指數」）表現緊密相關的投資回報。

### 策略

管理人將主要採用全面模擬策略，透過按指數成份股納入指數的基本相同比重直接投資於成份股，以達致子基金的投資目標。子基金可投資於（包括但不限於）下列中華人民共和國（「中國」）包括中國內地（「中國內地」）相關證券：A股、H股、N股、P股及紅籌股。子基金將透過滬港通及深港通（統稱「股票市場交易互聯互通機制」）投資於指數內的A股，包括深圳證券交易所中小企業板（「中小板」）及／或創業板的股票。子基金亦可能投資於合資格納入指數內的美國預託證券（「美國預託證券」）。

倘採納全面模擬策略並不符合效益或不切實可行，或在管理人全權酌情認為屬適當的情況下，管理人可採用代表性抽樣策略，持有由管理人使用以某規則為依據的定量分析模式選出可代表指數的抽樣成分證券，從而建立投資組合樣式。管理人可於採用代表性抽樣策略時使子基金偏離指數比重，惟條件是與任何成份股指數比重的最大偏離值不得超過有關比重的正負3個百分點。

投資者務請注意，管理人可在未事先通知投資者的情況下，全權酌情按其認為屬適當的頻率在全面模擬策略及代表性抽樣策略之間轉換，以便為投資者的利益而盡可能緊密地（或有效地）追蹤指數，實現子基金的投資目標。

目前，管理人無意將子基金投資於任何金融衍生工具作投資用途，但可能僅使用金融衍生工具進行避險，而且將不會進行證券借貸交易、回購或反向回購交易及其他類似的場外交易。於進行任何有關投資前，管理人將尋求證監會事先批准（如有需要），並向股東發出至少一個月的事先通知。

子基金的投資策略受基金說明書第一部分載列的投資及借貸限制的規限。

### 指數

指數為自由流通市值加權指數及股票基準，專門用於追蹤已於中國內地及香港設立總部或註冊成立、專注於生產及開發硬件及軟件產品及有能力執行高精度及自動化水平工作的公司的表現。指數旨在物色機械人及人工智能整個價值鏈中的主要參與者，包括工業自動化機械、人工智能軟件及機械人製造商。

指數由多個證券組成（包括常見股票及美國預託證券），該等證券由已於中國內地或香港設立總部或註冊成立的公司發行，並已於香港、中國內地或美國上市。該等公司可分為兩類：(i)工業自動化機械及機械人製造商或(ii)人工智能軟件。每個類別的候選公司必須在其於FactSet Research Systems Inc.（「FactSet」或「指數提供者」）的公司描述或其年報文件內業務概覽一節中載有與其各自類別相關的關鍵字（須定期審閱及可予修訂）的提述，並根據FactSet用於釐定證券經濟類別的專有行業分類矩陣的基準，分類為其各自類別的「第6級」子行業（其列表載於基金說明書）。此外，該等公司於最近十二個月的股本回報率（即最近十二個月的收入淨額除以股東權益）必須大於零。

指數計算方法由FactSet釐定，而指數已於2020年7月30日推出。管理人（及其每名關連人士）均獨立於指數提供者。Solactive AG（「指數計算代理」）負責有關指數的運作、計算、維護及記錄。

指數為淨總回報指數。淨總回報指數尋求複製來自持有由指數成份股組成的投資組合的整體回報，而在計算指數時將會計及股息等款項（經扣除任何預提稅項或持有該指數成份股的投資者一般須承擔的其他金額）。指數以人民幣計價及報價。於2021年3月31日，指數包含25隻成份股，總自由流通調整市值約為人民幣1,986,157百萬元。

指數編制方法詳情可瀏覽<https://www.factset.com/company/resource-library?topic=Index%2BSolutions>（該網站未經證監會審閱）。指數成分資料（包括成分股列表及其各自的權重）可瀏覽<https://www.factset.com/company/resource-library?topic=Index%2BSolutions>（該網站未經證監會審閱）。

指數按下列識別碼發佈消息：

彭博： FDSAINTR Index

## 衍生工具的用途／投資於衍生工具

子基金的衍生工具風險淨額最高可達子基金資產淨值的50%。

## 子基金有哪些主要風險？

**投資涉及風險。投資此子基金，閣下有可能蒙受巨額／全額損失。請參閱基金說明書了解風險因素等詳情。**

### **1. 一般投資風險**

- 子基金的投資組合價值可能因以下任何一項主要風險因素而下降，因此閣下於子基金的投資可能蒙受損失。概不保證將能償還本金。

### **2. 股票市場風險**

- 子基金於股票證券的投資須承受一般市場風險，其價值可能因投資氣氛、政治、地緣政治及經濟狀況變動以及發行人特定因素等多種因素而波動。
- 一般來說，相比市值較大的公司，中小市值公司的股票流通性可能較低，而其股價較易受不利經濟發展的影響而波動。

### **3. 機械人及人工智能行業風險**

- 子基金主要投資於機械人及人工智能行業公司的股票證券，並因此對此類公司所面臨的風險尤其敏感。該等風險包括但不限於該等證券市場規模較少或有限、業務週期變動、全球經濟增長、科技發展、容易過時及政府規例。機械人及人工智能公司的證券（尤其是市值最對較低且營運歷史有限的公司）的波動傾向較並非依賴科技的公司的證券更大。影響公司產品的科技的迅速轉變，或會對該公司的經營業績造成重大不利影響。機械人及人工智能公司或會同時依賴專利、版權、商標及商業秘密法律，以設立並保障其產品及技術的所有權。概無保證該等公司就保障其所有權所採取的步驟將足以避免其技術被盜用，或競爭對手將不會獨立開發出與該公司的技術大致相同或更佳的技术。全球各地日漸提高對數據收集、儲存及使用的監管審查，亦可能會妨礙新機械人及人工智能產品的開發、阻礙該等產品的商業發佈及影響市場需求。
- 此外，從事機械人及人工智能行業的公司往往研發開支繁多及龐大，而且概不保證該等公司所生產的產品將能在商業上獲得成果。此外，由於機械人及人工智能行業或會被視為易受國家利益影響，故此行業或會受政府干涉、制裁及貿易保護主義影響。從事機械人及人工智能行業的公司能否成功，往往須視乎該等公司與其技術合作夥伴維持關係的能力。倘公司與其技術合作夥伴的關係轉差或被終止，該公司未必能及時或按有利商業條款締結新的技術聯盟，從而導致其產生重大額外成本或業務受阻。

### **4. 集中風險**

- 子基金的投資集中於中國內地及香港機械人及人工智能行業。子基金的價值可能較具有更廣泛投資組合的基金更為波動。
- 子基金的價值可能較容易受影響中國內地及香港市場的經濟、政治、政策、外匯、流動性、稅項、法律或監管事件的不利情況所影響。

### **5. 貨幣風險**

- 子基金的基礎貨幣及若干相關投資均以人民幣計價，但子基金的交易貨幣為港元及美元。子基金的資產淨值及其表現可能因上述貨幣與基礎貨幣之間的匯率波動和匯率管制變動而受到負面影響。

### **6. 與中國內地相關的風險**

- 中國內地是一個新興市場。子基金投資於中國內地公司可能涉及更高的風險和特別不同於投資較成熟市場的特殊考量，例如流通性風險、貨幣風險／控制、政治及經濟不確定性、法律及稅務風險、結算風險、託管風險以及出現大幅波動的可能性。
- 中國內地的 A 股市場高度波動，且可能存在潛在交收困難。A 股價格可大幅升跌，與較成熟的市場相比，其波幅或會較大。有關波幅可能導致 A 股暫停交易或中國內地當局實行其他措施以影響股份的買賣／交易或中斷股份的增設及贖回，從而對子基金的價值造成不利影響。此外，倘參與交易商認為 A 股未必可供買賣，則其不大可能增設或贖回股份。
- 中國內地市場的證券交易所一般有關暫停或限制相關交易所的任何證券交易。政府或監管機構也可能制定影響金融市場的政策。上述均可能對子基金造成負面影響。

### **7. 人民幣的貨幣及兌換風險**

- 人民幣現時不可自由兌換，而且受到外匯管制及限制。
- 不使用人民幣計價的投資者須承擔外匯風險，且概不保證人民幣兌投資者的基礎貨幣（例如港元）將不會貶值。倘人民幣出現任何貶值，則會對投資者於子基金的投資價值有負面影響。
- 儘管離岸人民幣和在岸人民幣為同種貨幣，但兩者具有不同的匯率。倘離岸人民幣與在岸人民幣出現任何價值偏離，則或會對投資者造成負面影響。
- 在例外情況下，以人民幣支付贖回及 / 或分派款項可能因適用於人民幣的匯率管制或限制而有所延遲。

### **8. 人民幣分派風險**

- 投資者務請注意，倘股東持有在港元或美元櫃台買賣的股份，則相關股東將僅以人民幣而非港元或美元收取分派。倘相關股東並無人民幣賬戶，則股東可能須承擔將有關分派由人民幣兌換為港元、美元或任何其他貨幣的費用及收費。務請股東與其經紀確認有關分派的安排。

## 9. 股票市場交易互聯互通機制的風險

- 股票市場交易互聯互通機制的相關規例及規則可予以更改，且有關更改可能具有潛在追溯效力。股票市場交易互聯互通機制設有額度限制。倘透過股票市場交易互聯互通機制實施交易暫停，則子基金透過該機制投資於 A 股或進入中國內地市場的能力將會受到不利影響。在此情況下，子基金實現其投資目標的能力可能受到負面影響。

## 10. 中小板及創業板的市場風險

- 股價波幅較高—中小板及／或創業板上的上市公司通常屬新興性質，營運規模較小。因此，相對於深交所主板（「主板」）上市的公司，該等公司的股價及流動性波動較大，且風險及周轉率較高。
- 高估估值風險—於中小板及／或創業板上市的股票的價值可能會被高估，而該極高估值未必會持續。由於流通股份較少，股價可能更易被操控。
- 法規差異—與主板及中小板的上市公司相比，涉及創業板上市公司的規則及法規在盈利能力及股本方面較不嚴格。
- 除牌風險—中小板及／或創業板上市公司被除牌的情況可能更普遍及快速。倘子基金投資的公司被除牌，可能會對其造成不利影響。

## 11. 與美國預託證券相關的風險

- 投資美國預託證券相比直接投資相關股票而言可能產生額外風險，包括託管銀行持有的相關股票與該銀行本身資產的不分離風險及流動性風險（因美國預託證券的流動性普遍低於相關股票）。存託銀行的破產事件可能導致交易暫停，乃至受影響的美國預託證券的價格遭凍結，繼而對子基金的表現及／或流動性造成負面影響。此外，美國預託證券的持有人一般並無相關股票的直接股東所擁有的同等權利。美國預託證券的表現亦可能受相關費用所影響。

## 12. 依賴指數計算代理的風險

- 指數提供者依賴指數計算代理計算及維護指數，並在指數專業知識方面提供持續不斷的支持。倘指數計算代理不再向指數提供者提供此類支持或不再擔任指數的指數計算代理，指數提供者未必能即時覓到具備必要專業知識或資源的繼任指數計算代理，及未必能按同等條款委任任何新指數計算代理，且新指數計算代理亦未必具備相若的質素，而此情況或會對子基金造成負面影響。然而，由於指數提供者備有一份合資格擔任指數的指數計算代理一職的候選人名單，故此風險已降至最低。

## 13. 中國內地稅務風險

- 與子基金在中國內地透過股票市場交易互聯互通機制變現投資資本收益相關的中國內地現有稅法、法例及慣例（可能具有追溯效力）具有風險及不確定性。倘子基金的稅務責任有所增加，則或會對子基金的價值造成負面影響。
- 根據專業及獨立的稅務意見，子基金將不會透過股票市場交易互聯互通機制買賣 A 股所得的已變現或未變現資本收益總額，計提任何預扣企業所得稅撥備。
- 倘中國國家稅務總局收取實際稅款，而子基金須就其不計提撥備的稅務責任作出付款，由於子基金最終將須承擔全部稅務責任，子基金的資產淨值可能受到不利影響。在此情況下，該等稅務責任將僅影響在相關時間的已發行股份，且當時現有的股東及其後的股東將受到不利影響，導致該等股東透過子基金所承擔的稅務責任與其投資於子基金時的稅務責任比較將會不合比例地偏高。

## 14. 被動投資風險

- 子基金採用被動方式管理，而由於子基金本身屬投資性質，導致管理人將無權採取對策適應市場變動。倘指數下跌，預期將會導致子基金的價值出現相應的跌幅。

## 15. 追蹤誤差風險

- 子基金可能會受到追蹤誤差風險影響，即其表現可能無法完全追蹤指數的表現。此追蹤誤差可能是由於所使用的投資策略、費用及開支所致。管理人將監察並致力管理此風險，將追蹤誤差減至最低。概不保證可以準確或完全複製指數於任何時間的表現。

## 16. 交易風險

- 股份於聯交所的成交價乃受股份供求狀況等市場因素帶動。因此，股份的買賣價與子基金的資產淨值之間可能會出現重大溢價或折讓。
- 由於投資者於聯交所買賣股份時會支付若干費用（如交易費及經紀費），故投資者於聯交所買入股份時，可能需支付較每股股份資產淨值高的款額，在聯交所賣出股份時所收取的款額亦可能較每股股份資產淨值為低。

## 17. 交易差異風險

- 由於中國內地或美國的相關證券交易所可能會在子基金股份未定價時開市，因此子基金投資組合中的證券價值可能會在投資者未能買賣子基金股份的日子出現變動。
- 中國內地或美國的相關證券交易所與聯交所的交易時段不同，因而可能擴大股份價格與其資產淨值之間的溢價或折讓水平。
- A 股的交易範圍受到限制，令交易價格的漲跌幅受限，而於聯交所上市股份則無該等限制。此項差異亦可能擴大股份價格與其資產淨值之間的溢價或折讓水平。

## 18. 終止風險

- 在指數不再能用作基準分析或子基金的資產淨值少於 50,000,000 港元（或子基金基礎貨幣等額）等若干情況下，子基金或會被提早終止。投資者在子基金終止時可能無法取回其投資及蒙受損失。

## 19. 依賴莊家的風險

- 儘管管理人將盡力制定措施，確保至少一名莊家將就股份維持一個市場，並確保至少一名莊家在終止相關莊家協議的莊家活動前發出不少於三個月的通知，惟倘股份並無或僅有一名莊家，股份的市場流通性可能會受到不利影響。亦概不保證任何莊家活動將行之有效。

## 20. 以資本／實際以資本支付分派的風險

- 以資本或實際以資本支付分派，等於投資者就部分原投資獲得的回報或提取的金額或可歸屬於該原投資的任何資本收益。任何有關分派可能導致子基金的每股股份資產淨值即時減少，並將減少可供未來投資的資本。

## 21. 雙櫃台風險

- 倘股份在各櫃台之間的跨櫃台過戶暫停及／或經紀和中央結算系統參與者的服務有任何程度的限制，股東將僅可在一個櫃台買賣其股份，並可能令投資者的買賣受阻或延遲。股份在各櫃台的買賣市價可能存在重大差異。因此，投資者於一個櫃台出售或購入買賣股份時，倘相關股份另一櫃台進行買賣，則其需支付的金額可能超過另一櫃台貨幣等值金額，而收取的金額可能少於另一櫃台貨幣等值金額。

## 子基金的業績表現如何？

由於子基金是新設立，故並無足夠數據為投資者提供有用的過往業績表現指標。

## 子基金有否提供保證？

子基金並不提供任何保證。閣下未必能取回投資金額。

## 投資子基金涉及哪些費用及收費？

### 在聯交所買賣子基金的收費

費用	金額
經紀費用	市價
交易徵費	交易價的 0.0027% <sup>1</sup>
交易費	交易價的 0.005% <sup>2</sup>
印花稅	無
跨櫃台過戶	5 港元 <sup>3</sup>

<sup>1</sup> 買賣雙方應各自支付相等於股份交易價 0.0027% 的交易徵費。

<sup>2</sup> 買賣雙方應各自支付相等於股份交易價 0.005% 的交易費。

<sup>3</sup> 香港結算公司將向各中央結算系統參與者就每項指示收取 5 港元的費用，以促使子基金由其中一個櫃台跨櫃台過戶另一櫃台。投資者應與其經紀確認是否有任何額外費用。

### 子基金應持續繳付的費用

以下開支將從子基金中扣除。由於該等開支會令子基金的資產淨值下跌，並可能影響子基金交易價，因此會對閣下造成影響。

	每年收費率（佔子基金資產淨值的百分比（%））
管理費*	每年 0.50%
保管人費用*	每年最高 1%（每月最少 2,500 美元）
表現費	不適用
行政費	不適用
副保管人費用	已計入保管人費用內
登記處費用	初始設立費 20,000 港元及其後每年 24,000 港元

\*務請注意，有關費用可於向股東發出一個月的事先通知後增加至允許上限。請參閱基金說明書的「費用及收費」一節了解詳情。

### 其他費用

買賣子基金股份時，閣下或須支付其他費用。請參閱基金說明書了解詳情。

### 其他資訊

閣下可於以下網址 <https://www.globalxetfs.com.hk/> (未經證監會審批) 查閱以下有關子基金的資料 (提供中英文版本)：

- 載有本產品資料概要的基金說明書 (經不時修訂)
- 最新年度財務報告及未經審核中期半年度財務報告 (只提供英文版)
- 有關子基金出現重大變動而可能影響投資者 (例如對基金說明書 (包括本產品資料概要) 或本公司及/或子基金的任何組成文件作出重大改動或增補) 的任何通知
- 管理人就子基金對公眾人士發出的任何公告，包括有關子基金及指數的資料、暫停增設及贖回股份、暫停計算其資產淨值、其費用變動以及暫停和恢復買賣其股份
- 每股子基金股份接近實時的指示性資產淨值 (以人民幣、港元及美元計值，於各交易日整日每 15 秒更新一次)
- 子基金的最後資產淨值 (僅以人民幣計值) 及每股子基金股份的最後資產淨值 (以人民幣、港元及美元計值) (於各交易日每日更新一次)
- 子基金的過往表現資料
- 子基金的年度追蹤偏離及追蹤誤差
- 子基金全面的投資組合資料 (每日更新一次)
- 子基金的參與交易商及莊家的最新名單
- 分派 (如有) 的組成 (即過去 12 個月中從(i)可分派收入淨額及(ii)資本派出的相對金額)

上文所指每股股份接近實時的指示性資產淨值 (以港元及美元計值) 屬指示性及僅供參考。該項數據於聯交所交易時段內每 15 秒更新一次，並由 ICE Data Services 計算得出。

以港元和美元釐定的接近實時指示性的每股股份資產淨值是以人民幣釐定的接近實時指示性的每股股份資產淨值乘以 ICE Data Services 所提供之港元兌人民幣和美元兌人民幣的實時匯率計算。由於每股股份的資產淨值 (以人民幣計值) 在相關 A 股市場收市後將不再更新，有關期間內每股股份指示性資產淨值 (以港元及美元計值) 的變動 (如有) 乃全因匯率變動所致。

每股股份的最後資產淨值 (以港元及美元計值) 屬指示性及僅供參考，且各自按每股股份的最後資產淨值 (以人民幣計值) 乘以保管人提供的於同一個交易日倫敦時間下午 4 時整路透社所報的港元兌人民幣和美元兌人民幣匯率計算。每股股份的最後正式資產淨值 (以人民幣計值) 及每股股份的指示性最後資產淨值 (以港元及美元計值) 在相關 A 股市場收市後將不再更新。請參閱基金說明書了解詳情。

### 重要提示

閣下如有疑問，應諮詢專業意見。

證監會對本概要的內容概不負責，對其準確性或完整性亦不作出任何聲明。

本公司已於證監會註冊為開放式基金型公司。本公司及子基金已獲證監會認可為集體投資計劃。於證監會註冊並獲其認可並不代表對本公司或子基金作出推介或認許，亦不是對本公司、子基金或其表現的商業利弊作出保證。其不表示本公司或子基金適合所有投資者，亦並無認許其適合任何個別投資者或投資者類別。