



Global X ETF 系列 –
Global X 恒生 ESG ETF（上市類別）

2024 年 4 月 29 日

- 本子基金是被動式交易所買賣基金。
- 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：	3029
每手交易數量：	50個單位
基金管理人：	未來資產環球投資（香港）有限公司
受託人：	Cititrust Limited
託管人：	Citibank, N.A.
執行人：	Citibank, N.A. 香港分行
一年內持續收費*：	0.29%
上曆年追蹤偏離**：	-0.26%
相關指數：	恒指 ESG 增強指數
基礎貨幣：	港元
交易貨幣：	港元
派息政策：	Global X 恒生 ESG ETF 旨在按管理人酌情支付年度現金分派（通常為每年五月）。並不保證分派（如有）金額或股息率。分派可以資本或實際以資本支付，惟倘子基金營運成本高於子基金現金及所持投資產品的管理收益，則不可支付分派。
	所有單位的分派僅以港元支付。
子基金財政年度終結日：	3月31日
ETF 網站#：	https://www.globalxetfs.com.hk/

*持續收費數據為年度化數據，乃根據子基金的持續開支計算，並以子基金同時期的平均資產淨值（定義見下文）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。由於子基金採用單一管理費結構，子基金的持續收費將相等於單一管理費的金額，最高不超過子基金平均資產淨值的0.29%。超過子基金平均資產淨值0.29%的任何持續支出將由管理人承擔，而不會向子基金收取。請參閱下文「子基金應持續繳付的費用」及基金說明書了解詳情。

**此乃截至2023年12月31日止曆年的實際追蹤偏離。投資者應參閱子基金網站內更多實際追蹤偏離的最新信息。

此網站並未經證券及期貨事務監察委員會（「證監會」）審批。

子基金是甚麼產品？

- Global X 恒生 ESG ETF（「子基金」）是 Global X ETF 系列（「信托」）之下的投資基金，其是根據香港法例成立的傘子單位信託基金。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。
- 子基金提供上市類別單位（「上市類別單位」）及非上市類別單位（「非上市類別單位」）。本概要載有關於發售上市類別單位的資料，而除另有指明外，本概要凡提及「單位」均指「上市類別單位」。有關發售非上市類別單位的資料，投資者應參閱另一份概要。

- 子基金的上市類別單位猶如股票般於香港聯合交易所有限公司（「香港聯交所」）買賣。

目標及投資策略

目標

子基金試圖提供在扣除費用及開支前與恒指 ESG 增強指數（「**相關指數**」）表現緊密相關的投資回報。

投資策略

管理人將主要採用全面複製策略，按相關證券佔相關指數大致相同的比重，將子基金的全部或絕大部分資產直接投資於組成相關指數的證券，以達致子基金的投資目標。

倘採納全面複製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相關指數的抽樣成分證券，從而建立投資組合樣式。於採用代表性抽樣策略時，管理人可使子基金偏離相關指數比重，惟條件是與任何成分股相關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複製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）追蹤相關指數，實現子基金的投資目標。

子基金可將其不超過 5% 的資產淨值（「**資產淨值**」）投資於現金及根據守則第 8.2 章獲認可的貨幣市場基金或守則第 7.11A 章項下的合資格計劃，以作現金管理用途。

目前，子基金將不會進行銷售及回購交易、反向回購交易或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），並向單位持有人發出至少一個月的事先通知。

管理人可代表子基金進行最多達子基金資產淨值的 50%，預期為子基金淨資產值的約 20% 的證券借貸交易，並能隨時收回借出證券。

作為證券借貸交易的一部分，子基金必須收取現金及／或非現金抵押品，其每日的價值須為所借出證券價值（包括利息、股息及其他後續權利）的 100%。抵押品將由受託人或受託人指定的代理人保管。所收取的非現金抵押品不可出售、再作投資或質押。所收取的現金抵押品的任何再投資須遵守守則所載的規定。倘子基金進行證券借貸交易，所有產生的收益（在扣除直接及間接開支作為管理人、證券借貸代理人及／或其他服務供應商在適用法律和監管要求允許的範圍內，就有關交易所提供的服務支付的合理及正常補償後）應退還予子基金。

管理人可將不超過 10% 的子基金資產淨值投資於期貨以作投資及對沖用途，若管理人認為該等投資將有助於子基金實現其投資目標，並對子基金有利。子基金可能投資的期貨將為指數期貨，以管理子基金對相關指數成分股（例如恒生指數期貨）的投資。子基金將按相關指數成分股納入相關指數的基本相同比重（即比例）投資於該成分股。

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。

相關指數

相關指數為經修訂自由流通調整市值加權指數，旨在根據國際認可的環境、社會及管治（「**ESG**」）原則、數據、研究及評級並結合 ESG 舉措，衡量香港股市的整體表現。

相關指數的範圍包括恒生指數（「**基礎指數**」）的成分股，並已應用排除政策。基礎指數的成分股須為於香港聯交所主板上市的大中華公司證券。大中華公司指(i)於香港註冊成立的公司；(ii)中國內地公司（即H股、紅籌股及P股公司）；或(iii)過往營運、總部、管理層及／或主要營業點位於香港、澳門或中國內地的公司，但不包括外國公司、合訂證券及股票名稱以「B」結尾的生物科技公司。

相關指數的排除政策將基於三種ESG篩選方法，即(i)根據Sustainalytics的ESG風險評級（「**ESG風險評級**」）進行的ESG風險評級篩選（「**ESG風險評級篩選**」）；(ii)根據Sustainalytics、Arabesque S-Ray及ISS ESG的聯合國全球契約合規評級進行的聯合國全球契約（「**聯合國全球契約**」）原則篩選（「**聯合國全球契約原則篩選**」）；及

(iii)根據Sustainalytics的爭議產品參與數據進行的爭議產品參與篩選(「**爭議產品參與篩選**」)。

根據ESG風險評級篩選，基礎指數中的成份股根據ESG風險評級以遞降次序排列(即第一位為最高ESG風險)。基礎指數中ESG風險評級最高的10隻成份股將被剔除出相關指數。有關ESG風險評級篩選的緩衝區規則，請參閱基金說明書的相關附錄。ESG風險評級衡量公司經濟價值因財務上重大ESG風險因素而面臨的風險程度。ESG風險評級由促成公司整體評級的三個構建模塊組成，即企業管治、重大ESG問題及特殊問題(即發生爭議/突發事件)。ESG風險評級建立在二維方法之上，首先是「風險承擔」維度，反映公司面臨的重大ESG風險的程度，其次是「管理」維度，評估公司能否妥善管理這些風險。這兩個維度應用於三個構建模塊，而一家公司的整體ESG風險評級據此釐定。最終，對三個構建模塊各自的ESG風險評分匯總，以得出ESG風險評級的整體風險評估。有關ESG風險評級的進一步詳情，請參閱基金說明書的相關附錄。

根據聯合國全球契約原則篩選，Sustainalytics、Arabesque S-Ray及ISS ESG(「**聯合國全球契約評級機構**」)的聯合國全球契約合規評級已獲採用。若基礎指數成份股符合以下大部分(即超過50%)聯合國全球契約評級機構涵蓋該成份股的聯合國全球契約不合規標準，其將被剔除出相關指數。有關聯合國全球契約不合規標準的詳情，請參閱基金說明書的相關附錄。

根據爭議產品參與篩選，倘基礎指數成份股達致任何下列爭議產品參與限度，則將被剔除出相關指數：

產品參與篩選領域	限度
動力煤開採	大於或等於收入的5%
動力煤發電	大於或等於收入的5%
煙草製品生產	大於或等於收入的5%
煙草製品零售	大於或等於收入的5%
定制及必需爭議性武器	任何參與
非定制及非必需爭議性武器	任何參與

經應用上述三項篩選後的基礎指數的其餘證券將根據ESG風險評級進行調整。ESG風險評級相對較高(較低)的證券比重會被調低(調高)，惟相關指數每隻成份股的個別成份股比重上限為8%。

相關指數為淨總回報指數。淨總回報指數反映扣除任何預扣稅(包括特別徵費的任何附加費(如適用))後的股息或票息款項的再投資。

相關指數由恒生指數有限公司(「**恒生指數公司**」或「**指數提供者**」)編製及管理。管理人(及其各關連人士)獨立於恒生指數公司。

相關指數以港元計值及報價。

相關指數於2021年11月29日推出，於2018年12月7日的基數水平為6,000點。於2024年3月31日，相關指數的自由流通調整市值為17.50兆港元並擁有70隻成份股，在採用上述ESG篩選方法後，較基礎指數減少12隻成份證券。

相關指數按下列識別碼進行分派：

彭博編號：HSIESGSN

路透社編號：.HSIESGSN

指數成份股

相關指數成份股的完整名單與成份股比重及與相關指數的指數方法有關的額外資料刊載於<https://www.hsi.com.hk/eng/indexes/all-indexes/hsiesgs>(此網址並未經證監會審核)。

衍生工具的用途／投資於衍生工具

子基金的衍生工具投資淨額可最多為子基金資產淨值的 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。無法保證子基金將達致其投資目標。

2. 股票市場風險

- 子基金投資於股本證券須承受一般市場風險，而其價值可能因各種因素而波動，例如投資情緒轉變、政治及經濟狀況及發行人特定因素。

3. 新指數風險

- 相關指數為新指數。相關指數的營運歷史較短，投資者難以評估其過往表現，故此無法保證相關指數的表現。子基金可能會較其他追蹤較成熟、具有較長營運歷史的指數的交易所買賣基金面臨更高風險。

4. 與 ESG 投資有關的風險

- 使用 ESG 標準構建相關指數可能會影響子基金的投資表現，因此，子基金的表現可能不同於不使用該標準的類似基金。相關指數的挑選方法使用基於 ESG 的剔除標準可能會導致相關指數剔除特定證券，而投資該等證券原本可能有利於子基金。
- 相關指數的構建（包括成分股選擇及指數計算）基於（其中包括）各種 ESG 評估及評級的結果以及採用若干基於 ESG 的剔除因素等。相關指數的表現可能遜色於採用類似投資目標但不進行類似（或任何）ESG 評級評估及基於 ESG 的剔除的投資組合，因而可能影響子基金的投資組合表現。
- 子基金的投資可能集中在更重視 ESG 的公司，因此，其價值波動可能較投資組合更加多元化的基金劇烈。
- 相關指數的成分股選擇及指數計算流程涉及基於 ESG 標準的分析及剔除。儘管管理人及指數提供者審慎依賴 ESG 相關數據及資料，但上述 ESG 數據供應商（即 Sustainalytics、Arabesque S-Ray 及 ISS ESG）作出有關 ESG 篩選的評估可能涉及定性因素，因此相關投資標準可能無法正確採用。
- 在基於 ESG 標準評估證券或發行人時，指數提供者依賴 ESG 數據供應商的資料及數據，惟有關資料及數據可能不時會不完整、不準確或未能提供，繼而可能影響指數提供者評估潛在成分股以納入相關指數或剔除在相關指數外的能力。無法保證指數提供者基於 ESG 數據供應商的數據作出的評估將反映實際情況，或所選證券將符合 ESG 標準。上述所有因素均可能導致子基金放棄符合相關 ESG 標準的投資機會，或投資不符合有關標準的證券。
- 此外，ESG 投資策略缺少標準化的分類法。基金就相關 ESG 因素或原則採用的披露標準可能不同。

5. 與投資於存在同股不同權的公司有關的風險

- 子基金可能投資於採用同股不同權結構的公司（如創新公司）。這導致出現與股東權利和企業管治以及投資者保障有關的問題，若子基金投資於該等公司的普通股份，則可能會對子基金造成負面影響。

6. 地理集中風險

- 由於相關指數追蹤於香港聯交所上市，且註冊成立地或大部分收入來源或主要營業地點為大中華區的公司證券表現，因而承受集中性風險。因此，子基金的資產淨值可能會較基本面廣的基金（如全球性或區域性基金）更加波動，因為相關指數更容易受到影響大中華區的不利經濟、政治、政策、外匯、流動

性、稅務、法律或監管事件導致的價值波動所影響。

7. 證券借貸交易風險

- 借用人可能無法按時或甚至根本不能歸還借出的證券，從而可能使證券借貸交易承受風險。子基金可能因此蒙受損失，而追回借出的證券亦可能有延誤。這可能限制子基金根據贖回要求履行交付或付款責任的能力。
- 作為證券借貸交易的一部分，子基金必須收取最少達借出證券估值 100%的現金抵押品，而抵押品須每日估值。然而，由於借出證券定價不準確或借出證券價值變動，故存在抵押品價值不足的風險。這可能導致子基金蒙受重大損失。
- 進行證券借貸交易時，子基金須承受營運風險，例如延誤或未能結算。上述延誤及未能結算可能限制子基金根據變現要求履行交付或付款責任的能力。

8. 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。倘相關指數下跌，預期將會導致子基金的價值出現相應的跌幅。

9. 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相關指數表現的風險。此追蹤誤差可能是由於所使用的投資策略以及所產生的費用及開支所致。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相關指數於任何時間的表現。

10. 交易風險

- 上市類別單位於香港聯交所的成交價受市場因素，如上市類別單位的供求帶動。因此，上市類別單位可能會以子基金資產淨值的重大溢價／折讓成交。
- 由於投資者於香港聯交所買賣上市類別單位時將支付若干收費（如交易費及經紀費），故投資者於香港聯交所買入上市類別單位時，可能要支付較每單位資產淨值為高的款額，亦可能在於香港聯交所賣出上市類別單位時收取較每單位資產淨值為低的款額。

11. 上市類別單位及非上市類別單位之間的買賣安排不同的風險

- 上市類別單位及非上市類別單位的投資者受不同的定價及買賣安排所規限。由於適用於各類別的費用及成本不同，上市類別單位及非上市類別單位各自的每單位資產淨值可能不同。適用於二手市場上市類別單位的香港聯交所交易時段與非上市類別單位的交易截止時間亦有所不同。
- 上市類別單位的單位按日內現行市價（其可能偏離相應的資產淨值）在二手市場證券交易所買賣，而非上市類別單位的單位則透過中介機構按交易日結束時的資產淨值出售，並於單一估值點交易而不會擁有在公開市場交易的日內流動性。視乎市況，非上市類別單位的投資者與上市類別單位的投資者相比可能處於有利或不利地位。
- 在市場受壓的情況下，非上市類別單位的投資者可按資產淨值變現其單位，而在二手市場買賣上市類別單位的投資者僅可按現行市價（其可能偏離相應的資產淨值）變現，並可能須按大幅折讓的價格退出子基金。另一方面，上市類別單位的投資者可於當天在二手市場出售其單位，從而變現其持倉，但非上市類別單位的投資者則無法及時進行此類出售，而僅可於當天結束時方可出售其單位。

12. 上市類別單位及非上市類別單位之間的成本機制不同的風險

- 投資者應注意，上市類別單位及非上市類別單位應用不同的成本機制。就上市類別單位而言，有關設立及變現申請的交易費和稅項及徵費是由申請或變現有關單位的參與證券商及／或管理人支付。在二手市場買賣上市類別單位的投資者將不會承擔該等交易費和稅項及徵費（但為免生疑問，或會承擔其他費用，例如香港聯交所交易費）。
- 另一方面，認購及變現非上市類別單位或須分別繳付認購費及變現費，並将由進行認購或變現的投資者支付予管理人。此外，於釐定認購價及變現價時，管理人有權調高/調低其認為適合財務及購買/銷售費

用的金額。

- 任何或所有該等因素均可能會導致上市類別單位及非上市類別單位的資產淨值出現差異。

13. 終止風險

- 在相關指數不再能用作基準分析或子基金的資產淨值少於 5,000 萬港元等若干情況下，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。

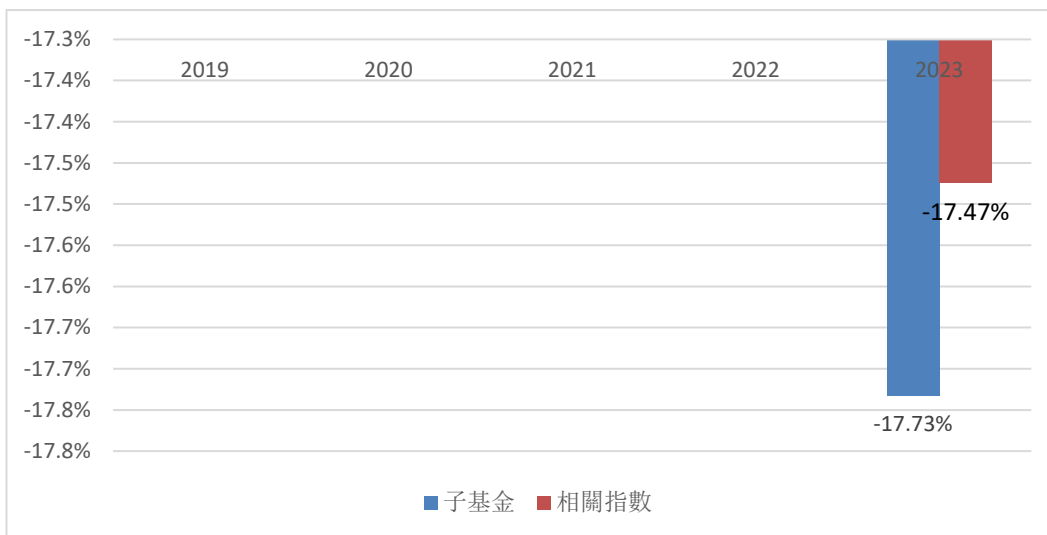
14. 依賴莊家的風險

- 儘管管理人將盡力制定措施，確保至少一名莊家將就上市類別單位維持一個市場，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，惟倘上市類別單位並無或僅有一名莊家，上市類別單位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。

15. 從資本中或實際上從資本中撥付分派的風險

從資本中及／或實際上從資本中撥付分派，意即退還或提取投資者原先投資或當中應佔任何資本收益的部分款項。任何分派如涉及從子基金的資本中或實際上從子基金的資本中撥付股息，可能會導致子基金每單位資產淨值即時減少，並將減少可供未來投資的資本。

子基金的業績表現如何？



- 過往業績資料並不代表將來表現。投資者未必能取回全部投資金額。
- 業績表現以曆年末的資產淨值作為計算基礎。
- 此等數據顯示子基金價值在有關曆年內的升跌幅度。業績表現以人民幣計算，當中包括持續收費，但不包括閣下可能需繳交的香港聯交所交易成本。
- 若未有列示過往業績，即表示該年度未有足夠數據以提供表現。

子基金推出日期：2022年3月21日

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？

在香港聯交所買賣子基金的收費

Global X ETF 系列一
Global X 恒生 ESG ETF (上市類別)

費用	金額
經紀費用	市價
交易徵費	交易價的0.0027% ¹
會計及財務匯報局（「會財局」）交易徵費	交易價的0.00015% ²
交易費	交易價的0.00565% ³
印花稅	無

¹ 買賣雙方應各自支付相等於單位交易價格 0.0027% 的交易徵費。

² 買賣雙方應各自支付相等於單位交易價格 0.00015% 的會財局交易徵費。

³ 買賣雙方應各自支付相等於單位交易價格 0.00565% 的交易費。

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*	目前每年0.29%
受託人費用	已計入單一管理費（定義見下文）內
登記處費用	已計入單一管理費內
表現費	不適用
行政費	不適用

*管理費為劃一固定費用，以子基金的資產支付，涵蓋子基金的一切成本、費用及開支包括就組合管理服務應付予管理人的費用、管理人的服務費（如有）、受託人費用、過戶登記處的費用、服務代理人費用及子基金的營運費用（「單一管理費」）。超越單一管理費之任何與子基金有關的成本、費用及開支應由管理人承擔及不應由子基金支付。為免生疑，單一管理費不包括（以不包括在基金說明書所載的營運費用為限）投資者於增設及變現單位時應付的任何成本、費用及開支，例如支付予參與證券商的費用、經紀費、交易徵費、交易費及印花稅，或可能不時產生的任何特殊或特別費用及開支（例如訴訟開支）及將以子基金的資產另行支付的任何與子基金有關的稅項責任。此外，單一管理費並不代表子基金的估計追蹤誤差。

請注意，如果提前通知單位持有人一個月，則單一管理費可能會增加到允許的最高限額。有關詳細信息，請參閱基金說明書的「費用及收費」一節。

其他費用

買賣子基金單位時，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（除非另有指明，提供中英文版本）：

- 基金說明書及本產品資料概要（經不時修訂）；
- 最新年度經審核財務報告及中期未經審核財務報告（只提供英文版）；
- 管理人就子基金對公眾人士發出的任何公告，包括關於子基金及相關指數的資料、暫停增設及贖回單位、暫停計算資產淨值、費用及收費變動以及暫停和恢復買賣的通知；
- 任何有關對子基金的重大變更而可能對其投資者有影響的通知，例如子基金的基金說明書（包括本產品資料概要）或信托及/或子基金的組成文件作出重大修改或增補；
- 子基金的完整投資組合資料（每日更新一次）；
- 子基金在各交易日整日接近實時的指示性每單位資產淨值（港元）（在香港聯交所交易時段內每 15 秒更新一次）；
- 子基金的最後資產淨值（以港元計值）及最後每單位資產淨值（以港元計值）；

- 子基金的上市類別單位及非上市類別單位過往表現資料；
- 子基金的上市類別單位及非上市類別單位持續收費；
- 子基金的年度追蹤偏離及追蹤誤差；
- 分派的組成（即過去十二個月中淨分派的收入和資本相對派出的金額，如有）；
- 子基金參與證券商及莊家的最新清單；及
- 管理人的代理投票政策。

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。