

3416

Global X國指成份股備兌認購期權
主動型ETF類別: 收益
截至 29/11/2024

重要資料

投資者請勿單憑本網頁作投資決定，應閱讀本產品的基金說明書所載的詳情及風險因素。投資涉及風險，過往業績並不代表未來表現。概不能保證本金會獲得償還。投資者應注意：

- Global X國指成份股備兌認購期權主動型ETF（「本基金」）的投資目標是透過主要(i)投資於恒生中國企業指數（「參考指數」或「國指」）的成份股本證券；及(ii)出售（即「沽出」）參考指數的認購期權以收取認購期權買方支付的款項（即「期權金」），以產生收入。
- 採用備兌認購期權策略的目標為產生收入及減少市場下跌時的潛在虧損。本基金每次沽出國指認購期權均會收取期權金。倘本基金所持有的參考指數相關證券價值下跌，本基金就沽出國指認購期權收取的期權金或可在一定程度上減少有關損失。然而，採用備兌認購期權策略的缺點是本基金從參考指數水平上升獲利的潛力有限，以所沽出的國指認購期權的行使價為限，再加上所收取的期權金。
- 本基金為交易所買賣基金（「ETF」），其採用備兌認購期權策略，方式為(i)投資於參考指數及國指ETF的成份股本證券以及恒指期貨的長倉；及(ii)沽出參考指數的認購期權。本基金是香港首批備兌認購期權ETF之一。鑒於本基金屬新產品，與投資於股本證券的傳統ETF相比，其風險程度較高。
- 本基金採用主動式管理的投資策略。除尋求透過直接投資於參考指數及國指ETF的成份股本證券以及國指期貨的長倉，以按相關證券佔參考指數大致相同的比重投資於參考指數的成份股本證券外，本基金亦會沽出參考指數的認購期權。由於實施的投資程序可能導致本基金表現低於直接投資於參考指數的成份股本證券，本基金可能無法達成其目標。
- 國指認購期權的市值可能受一系列因素影響，包括但不限於供需情況、利率及參考指數的現行市價（相對於國指認購期權行使價）、參考指數的實際或預期波動以及直至到期日的餘下時間。本基金成功利用恒指認購期權的能力將取決於管理人正確預測未來價格波動的能力，而此方面概無保證，並受限於市場行為或預期以外的事件。
- 倘國指認購期權到期，且參考指數市價於期權期間下跌，則本基金沽出國指認購期權收取的期權金可能不足以抵銷所變現的虧損。
- 本基金可能於交易所或場外市場沽出國指認購期權。場外市場的國指認購期權的流動性可能不如交易所上市期權。有意作為買方訂立國指認購期權的對方手數量可能有限，或本基金可能認為有關對手的條款遜於上市期權所享有的條款。再者，聯交所於波動市況下可能暫停期權買賣。倘被暫停交易，本基金未必能夠於合宜或有利的時機沽出國指認購期權。
- 使用期貨合約涉及的風險可能高於直接投資於證券及其他較傳統的資產的風險。儘管國指期貨市場的發展相對成熟，本基金面臨其未必可終止或出售持倉的潛在風險。風險包括但不限於波動風險、槓桿風險、負轉倉收益及「正偏差」風險。
- 投資國指期貨及沽出國指認購期權一般需提供保證金。可能需提供額外資金，以便按國指期貨及國指認購期權每日市價的折算值，追加保證金。由於保證金或類似的付款額增加，本基金可能需以不利的價格將其投資變現，以應付須追加的保證金。倘本基金因香港期貨交易所、聯交所及／或本基金的經紀所施加的保證金要求而無法達致其投資目標，本基金可能會面臨或會超過本基金初始投資金額的巨額損失。
- 國指期貨及國指認購期權由香港期貨結算公司登記、結算及擔保。如結算所破產，本基金可能須就其作為保證金的資產承受損失風險。
- 本基金因追蹤單一地區或國家（中國內地）的表現而承受集中風險。由於子基金較易受中國內地不利條件所引致的波動影響，故其波動性可能高於基礎廣泛的基金（如環球股票基金）。此外，由於參考指數成份證券集中於特定行業或市場內的香港上市內地證券，本基金的投資可能同樣集中。與投資組合較多元化的基金相比，本基金的價值可能較為波動。本基金的價值可能較容易受對上述特定市場／行業不利的情況所影響。
- 借用人可能無法按時或甚至根本不能歸還證券。本基金可能因此蒙受損失，而追借出證券亦可能有延誤。這可能限制本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，由於借出證券的定價不準確或借出證券的價值變動，存在抵押品價值不足的風險。這可能導致本基金出現重大虧損。
- 本基金的基準貨幣為港元，惟股份的類別貨幣為港元、人民幣及美元。本基金的資產淨值及其表現可能會因該等貨幣與基準貨幣之間匯率波動及匯率管制措施的變動而受到不利影響。
- 從資本中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。任何有關分派可能會導致本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。
- 本基金的單位於香港交易及結算所有限公司的成交價乃受單位供求狀況等市場因素帶動。因此，單位可能以對比其資產淨值的較大溢價或折讓買賣。

基金便覽

上市日期	29/02/24
股份代號 (HKD)	3416
持股數量	50
單位資產淨值	港元10.16
總資產淨值	美元 51.19 百萬
一年內持續收費*	0.75%
每手交易數量	500個單位
派息政策	由管理人每月酌情決定
上市交易所	香港交易所
ISIN	HK0000978954

投資目標

Global X 國指成份股備兌認購期權主動型ETF的投資目標是透過主要(i)投資於恒生中國企業指數（「參考指數」或「國指」）的成份股本證券；及(ii)出售（即「沽出」）參考指數的認購期權以收取認購期權買方支付的款項（即「期權金」），以產生收入。

表現 (%)

累積回報	資產淨值 (%)
1個月	-1.03
3個月	5.69
6個月	8.57
年初至今	-
上市至今	17.26

年化回報

1年	-
3年	-
5年	-
上市至今	-

歷年回報

2023	-
2022	-
2021	-
2020	-
2019	-

資料來源：未來資產環球投資（香港）有限公司，數據截至29/11/2024。基金表現數據為資產淨值對資產淨值，扣除費用，以港元計。若沒有顯示過往表現，即表示該年沒有足夠數據。

十大成分股 (%)

美國	8.17
中國建設銀行股份有限公司	6.26
騰訊控股有限公司	6.06
阿里巴巴集團控股有限公司	6.02
小米集團	4.93
中國移動有限公司	4.52
中國工商銀行股份有限公司	3.61
中國銀行股份有限公司	3.06
中國平安保險(集團)股份有限公司	3.04
中國海洋石油有限公司	2.71

過往12個月派息記錄

月份	總派息(每股) (港元)
2024年11月	0.15
2024年10月	0.15
2024年9月	0.15
2024年8月	0.15
2024年7月	0.15
2024年6月	0.15

* 請參閱該基金的發行文件，了解有關更多詳情（包括費用）。

本文件所載若干資料由第三方來源編纂。未來資產環球投資（香港）有限公司（「未來資產香港」），產品管理人，已盡其努力以確保該等資料均屬準確、完整及最新，並且已採取審慎措施以準確地複製有關資料。未來資產香港不會就因未經授權使用本文件所導致任何損失或損害負責。本文件所載資料僅供說明用途，並不構成於任何司法管轄區購買、銷售或認購任何證券或財務工具的任何建議、提呈或邀約。投資涉及風險，概不能保證本產品的表現將取得回報，並可能會出現取得零回報或損失所投資金額的情況。過往表現並不代表未來表現的指引。投資者在作出對本產品的任何投資決定前，應閱讀本產品的產品發行章程所載的詳情及風險因素。投資者應確保其完全明白本產品所附帶的風險，並且應考慮其本身的投資目標及風險承受程度。茲建議投資者在作出任何投資前，應徵求獨立專業意見。本產品的產品發行章程可於www.globalxetfs.com.hk網站獲得。文內所提及個別行業、證券或公司僅作一般資料及說明用途，並不是建議買賣有關證券，或代表發行人在任何時期持有該投資。投資者務請注意，本產品有別於典型零售產品，因為本產品單位或只可透過參與證券商以大額增設或變現單位。本文件由未來資產香港發行，並未經香港證券及期貨事務監察委員會審閱。請閱讀產品發行章程中有關該指數的免責聲明。