

重要提示：此乃要件，請即處理。如有疑問，請諮詢專業意見。

香港聯合交易所有限公司、香港交易及結算所有限公司（「**港交所**」）、香港中央結算有限公司及證券及期貨事務監察委員會（「**證監會**」）各自對本公告的內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並明確表示，概不對就因本公告全部或任何部分內容而產生或因倚賴該等內容而引致的任何損失承擔任何責任。管理人對本公告所載資料於發佈日期的準確性承擔全部責任，並確認在作出一切合理查詢後，據其所知及所信，本公告於發佈日期所表達的意見乃經審慎周詳考慮後作出。證監會的認可並不等於對該計劃作出推介或認許，亦不是對該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個別投資者或任何類別的投資者。

Global X Exchange Traded Funds Series OFC **（「本公司」）**

Global X 中國消費龍頭品牌 ETF

（港元櫃台股份代號：02806；美元櫃台股份代號：09806）

Global X 中國電動車及電池 ETF

（港元櫃台股份代號：02845；美元櫃台股份代號：09845）

Global X 中國潔淨能源 ETF

（港元櫃台股份代號：02809；美元櫃台股份代號：09809）

Global X 中國半導體 ETF

（港元櫃台股份代號：03191；美元櫃台股份代號：09191）

Global X 中國機械人及人工智能 ETF

（港元櫃台股份代號：02807；美元櫃台股份代號：09807）

Global X 中國全球領導 ETF

（股份代號：03050）

Global X 中國遊戲及娛樂 ETF

（股份代號：03117）

Global X 中國電子商務及物流 ETF

（股份代號：03124）

Global X 亞洲半導體 ETF

（股份代號：03119）

（各自為「子基金」，統稱為「該等子基金」）

(分別為根據香港法例第 571 章《證券及期貨條例》第 104 條獲認可，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香港公開傘子開放式基金型公司 Global X Exchange Traded Funds Series OFC 的子基金)¹

予股東通知 — 變更投資策略

親愛的股東：

作為本公司及該等子基金的管理人，吾等謹此知會股東有關該等子基金投資策略的若干變更，有關變更將於2023年1月9日（「生效日期」）生效：

變更投資策略

I. 採用合成模擬策略作為輔助策略

目前，各子基金主要採用全面模擬策略，按其各自的指數成份股納入指數的基本相同比重直接投資於成份股。

自生效日期起，管理人擬採用實物與合成模擬策略相結合的方式，使各子基金能夠在不同市況下盡可能緊密地複製有關指數的表現，以達致該等子基金各自的投資目標。

因此，自生效日期起，該等子基金（除 Global X 中國潔淨能源 ETF 外）各自的投資策略將變更如下：

	現時的投資策略	修訂後的投資策略（自生效日期起）
模擬策略	<p>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。</p> <p>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，持有由管理人選出可代表指數的抽樣成分證券。</p> <p>投資者務請注意，管理人可在未事先通知投資者的情況下，全權酌情在全面模擬策略及代表性抽樣策略之間轉換。</p>	<p>管理人擬採用實物與合成模擬策略相結合的方式，以達致子基金的投資目標。</p> <p>子基金：</p> <p>(i) 將其50%至100%的資產淨值直接投資於指數成份股；及</p> <p>(ii) 當管理人認為該等投資對子基金有利時，將採用合成模擬策略作為輔助策略，將其資產淨值的最多50%投資於金融衍生工具（主要為與一個或多個掉期交易對手方進行的融資總回報掉期交易）。</p>

¹證監會的認可並不等於對該計劃作出推介或認許，亦不是對該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個別投資者或任何類別的投資者。

		<p>子基金擬按指數成份股納入指數的基本相同比重投資於指數成份股（透過直接投資及／或透過金融衍生工具）（「投資策略」）。倘採納投資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（透過直接投資及／或透過金融衍生工具）投資於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。</p> <p>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上述策略之間轉換，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。</p>
<p>衍生工具的用途</p>	<p>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。</p>	<p>除掉期外，管理人亦可將不超過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展現出與相關指數有高度相關性的指數期貨，以管理子基金對指數成份股的投資。</p>

自生效日期起，Global X 中國潔淨能源ETF的投資策略將變更如下：

	現時的投資策略	修訂後的投資策略（自生效日期起）
<p>模擬策略</p>	<p>管理人將<u>主要採用全面模擬策略</u>，透過按指數成份股納入指數的基本相同比重<u>直接</u>投資於成份股，以達致子基金的投資目標。</p> <p>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</p>	<p>管理人擬採用<u>實物與合成模擬策略相結合的方式</u>，以達致子基金的投資目標。</p> <p>子基金：</p> <p>(i) <u>將其70%至100%的資產淨值直接投資</u>於指數成份股；及</p>

	<p>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。</p>	<p>(ii) 當管理人認為該等投資對子基金有利時，將採用合成模擬策略作為輔助策略，<u>將其資產淨值的最多30%投資於金融衍生工具（主要為與一個或多個掉期交易對手方進行的融資總回報掉期交易）</u>。</p> <p>子基金擬按指數成份股納入指數的基本相同比重投資於指數成份股（透過直接投資及／或透過金融衍生工具）（「投資策略」）。倘採納投資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（透過直接投資及／或透過金融衍生工具）投資於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上述策略之間轉換，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。</p>
<p>衍生工具的用途</p>	<p>目前，管理人無意將子基金投資於<u>任何金融衍生工具作投資用途</u>，但可能僅使用金融衍生工具進行避險。</p>	<p><u>除掉期外</u>，管理人亦可將不超過 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展現出與相關指數有高度相關性的指數期貨，以管理子基金對指數成份股的投資。</p>

該等子基金各自的衍生工具投資淨額仍將為最高可達其資產淨值的50%。

該等子基金將面臨下列與合成模擬策略有關的額外風險：

- **與投資於金融衍生工具有關的風險：**相關子基金的合成模擬策略涉及將其資產淨值的最多50%（或僅就Global X中國潔淨能源ETF而言，則30%）投資於金融衍生工具（主要為通過一個或多個對手方進行的融資總回報掉期交易）。除掉期外，子基金亦可投資於其他金融衍生工具，以作投資及對沖用途。因此，倘金融衍生工具的對手方未能履行其責任，或在對手方無力償債或違約的情況下，子基金可能蒙受重大損失。

與金融衍生工具有關的風險包括對手方／信貸風險、流動性風險、估值風險、波動風險及場外交易風險。金融衍生工具容易受到價格波動及較高波動性的影響，可能存在較大買賣差價及沒有活躍二級市場。金融衍生工具的槓桿元素／部分可造成的損失金額可能遠高於子基金投資於金融衍生工具的金額。投資於金融衍生工具可導致相關子基金面對大額損失的高風險。

- **合成模擬策略風險：**管理人尋求就所有對手方風險承擔作出全面抵押，以減低對手方風險。這便存在抵押品價值可能遠遠低於所擔保金額的風險，故子基金可能蒙受重大損失。任何損失將導致相關子基金的資產淨值減少，並損害相關子基金實現其追蹤指數的投資目標的能力。

倘對手方未能履行其於融資掉期下的義務，子基金可能蒙受重大損失。抵押品資產的價值（就融資掉期而言）可能受市場事件的影響，並可能顯著偏離指數的表現，這可能會導致相關子基金面臨掉期對手方的風險承擔抵押不足的情況（就融資掉期而言），因而導致重大損失。

- **與環境、社會和治理投資有關的風險：**就Global X中國潔淨能源ETF而言，子基金可投資於金融衍生工具（主要為融資總回報掉期交易）以獲得持倉，而無需直接投資於指數的成份股。管理人無法控制掉期對手方的對沖持倉，故子基金的相關資產部分（如就訂立的每份掉期合約轉給掉期對手方的現金）或會根據子基金的投資目標及策略，投資於不符合專注清潔能源的工具。

II. 證券借貸交易

為加強投資組合的有效管理，使管理人能更加靈活地管理子基金從事證券借貸交易，以達致各自的投資目標，子基金的證券借貸交易持倉將自生效日期起作如下調整：

子基金	現有證券借貸交易持倉	修訂後的證券借貸交易持倉（自生效日期起）
<ul style="list-style-type: none"> • Global X 中國消費龍頭品牌ETF • Global X 中國電動車及電池ETF • Global X 中國潔淨能源ETF 	<p>管理人可代表子基金進行最多達相關子基金資產淨值的 25%，並預期為相關子基金資產淨值的約 20% 的證券借貸交易。</p>	<p>管理人可代表子基金進行最多達相關子基金資產淨值的 50%，並預期為相關子基金資產淨值的約20% 的證券借貸交易。</p>

GLOBAL X

by Mirae Asset

<ul style="list-style-type: none">• <i>Global X 中國全球領導ETF</i>• <i>Global X 中國遊戲及娛樂ETF</i>• <i>Global X 中國電子商務及物流ETF</i>• <i>Global X 亞洲半導體ETF</i>		
<ul style="list-style-type: none">• <i>Global X 中國半導體ETF</i>• <i>Global X 中國機械人及人工智能ETF</i>	管理人無意代表子基金進行證券借貸交易。	管理人可代表子基金進行最多達相關子基金資產淨值的 50% ，並預期為相關子基金資產淨值的約20%的證券借貸交易。

所有產生的收益（扣除直接及間接開支，作為在適用的法律和監管要求允許的範圍內就管理人、證券借貸代理人及／或其他服務供應商就證券借貸交易所提供服務的合理及正常補償）應退還予該等子基金。與證券借貸交易有關的成本須由借用人承擔。

股東注意，**Global X中國半導體ETF**及**Global X中國機械人及人工智能ETF**可能會因進行證券借貸交易而面臨下列額外風險：

- **對手方風險：**借用人可能無法按時或甚至根本不能歸還證券。子基金可能因此蒙受損失，而追回借出證券亦可能有延誤。這可能限制相關子基金根據贖回要求履行交付或付款責任的能力。
- **抵押品風險：**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%的抵押品，而抵押品須每日按市價估值。然而，由於抵押品定價不準確、抵押品價值的不利市場走勢及借出證券的價值變動，故存在抵押品價值不足的風險。倘借用人未能歸還借出的證券，這可能導致相關子基金蒙受重大損失。子基金也可能面臨抵押品的流動性和託管風險以及執法的法律風險。
- **營運風險：**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相關子基金根據贖回要求履行交付或付款責任的能力。

對該等子基金的影響

該等子基金採用單一管理費結構。如基金說明書所披露，管理費並不包括經紀及交易成本。作出上述變動後，該等子基金各自將須承擔(i)進行掉期交易時的掉期費用，及(ii)作為管理人、證券借貸代理人及／或其他服務供應商就證券借貸交易提供服務的合理及正常補償的直接及間接開支（將自證券借貸交易產生的收益中扣除）。單一管理費不包括與該等子基金訂立金融衍生工具（包括掉期）有關的費用。該等子基金各自的單一管理費將維持不變。

除本公告所披露者外，該等子基金的運作及／或管理方式概不受影響，且上述變動不會影響該等子基金的現有投資者，該等子基金的特點或風險狀況亦不會發生改變。股東的權利或權益不會因本公告所載變動而嚴重受損。



本公告所述變動無需取得股東批准。與該等變動有關的成本及／或開支將由管理人承擔。

一般資料

除另有說明外，本公告所有詞彙與本公司日期為 2022 年 8 月 11 日的基金說明書（「**基金說明書**」）所界定者具有相同涵義。

基金說明書及該等子基金的產品資料概要已獲修訂，以反映上述變動以及其後的變動、修改及其他更新。最新的銷售文件可於生效日期在本公司網站 <https://www.globalxetfs.com.hk/>²及港交所網站 www.hkex.com.hk 閱覽。

閣下如對本公告有任何疑問，可於辦公時間聯絡管理人（地址為香港銅鑼灣新寧道 1 號利園三期 11 樓 1101 室）或透過查詢熱線(852) 2295-1500 聯絡管理人。

未來資產環球投資（香港）有限公司
作為本公司及該等子基金的管理人
日期：2022 年 12 月 9 日

² 該網站未經證監會審閱或批准。