

重要提示：此乃重要文件，需要閣下立即注意。如果您對本公告的內容有任何疑問，請尋求專業意見。

香港聯合交易所有限公司（「香港聯交所」）、香港交易及結算所有限公司（「香港交易所」）、香港中央結算有限公司，以及香港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，亦不對其準確性或完整性作出任何申述，並且明確地拒絕就由於或依賴本公告的全部或任何部分內容所引起的任何損失承擔任何責任。

基金經理於公告發佈日期對本公告所載資料的準確性承擔全部責任，並在作出一切合理查詢後確認，盡其所知及所信，於公告發佈日期，本公告內所述意見是經過適當和仔細考慮後得出的。

證監會的認可不等如對某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。

華夏基金環球 ETF 系列 （「本信託」）

（是一項根據香港法例第 571 章證券及期貨條例第 104 條獲認可的香港傘子單位信託）

華夏恒生香港生物科技指數ETF

港幣櫃台股份代號：03069

美元櫃台股份代號：09069

華夏恒生科技指數ETF

港幣櫃台股份代號：03088

美元櫃台股份代號：09088

（各自為「子基金」，統稱「該等子基金」）

公告

該等子基金非上市類別基金單位的引入

該等子基金上市類別基金單位新增人民幣櫃台

該等子基金上市類別基金單位分派政策的變更

華夏恒生科技指數 ETF 使用金融衍生工具及證券借貸交易

華夏基金（香港）有限公司，作為本信託及該等子基金的基金經理（「基金經理」），謹此通知基金單位持有人，自 2024 年 1 月 19 日（「生效日期」）起：

1. 該等子基金將引入非上市類別基金單位（「引入非上市類別基金單位」）；
2. 該等子基金的上市類別基金單位在多櫃台安排下在香港聯交所將以港幣、人民幣及美元進行交易（「增設人民幣櫃台」）；

3. 該等子基金上市類別基金單位的分派政策將會變更，以便該等子基金上市類別基金單位可由基金經理酌情決定從資本或實際上從資本和收入中支付分派（「**分派政策的變更**」）；
4. 華夏恒生科技指數 ETF 的投資策略將會變更，以便：
 - (i) 除從指數之成分公司的公司行動獲取以外，子基金可投資於金融衍生工具（「**金融衍生工具**」），包括但不限於作對沖或非對沖（即投資）用途的總回報指數掉期，並且子基金為非對沖（即投資）目的而持有的金融衍生工具將不超過子基金資產淨值（「**資產淨值**」）的 10%；
 - (ii) 子基金可進行證券借貸交易，最高為子基金資產淨值的 50%，預期最高為 20%；及
 - (iii) 考慮到就證券借貸交易可能收取的現金抵押品，子基金可持有不超過其資產淨值 50% 的貨幣市場工具和現金存款用於現金管理目的。（統稱為「**投資策略的變更**」）；及
5. 除上述變更外，該等子基金的基金章程（各自為「**章程**」）及/或產品資料概要（「**產品資料概要**」）（視情況而定）亦會更新，以反映 (i) 各子基金投資策略的某些澄清性變更；(ii) 有關基金經理信息的某些更新，以及 (iii) 其他雜項、編輯和行政變更（統稱為「**其他更新**」）。

除非另有說明，否則所用詞彙與該等子基金的章程中所述的含義相同。

投資者在處理該等子基金的基金單位時應謹慎行事。

1. 該等子基金非上市類別基金單位的引入

自生效日期起，該等子基金將引入非上市類別基金單位，為投資者提供認購該等子基金的基金單位的額外選擇。基金經理預計引入非上市類別基金單位將增加該等子基金的規模。透過非上市類別基金單位，投資者可以按該等子基金各自的資產淨值並透過經銷商直接認購／贖回該等子基金。

上市類別基金單位及非上市類別基金單位之間存在異同。特別是，子基金的上市類別基金單位和非上市類別基金單位的費用結構、投資回報和資產淨值將有所不同。章程將於生效日期修訂。投資者應參閱修訂後的章程（特別是「**概要**」部分），以了解有關上市類別和非上市類別基金單位異同的資訊。

該等子基金的上市類別基金單位的產品資料概要亦將於生效日期進行修訂，並且在生效日期將就各子基金的非上市類別基金單位發布獨立的產品資料概要。

2. 該等子基金上市類別基金單位新增人民幣櫃台

該等子基金的上市類別基金單位（「**上市類別基金單位**」）目前以港幣（「**港幣**」）計值，並以港幣和美元（「**美元**」）進行交易。基金經理已獲聯交所核准上市類別基金單位可於聯交所交易，並可在多櫃台安排下在中央結算及交收系統（「**中央結算系統**」）進行存款、結算及交

收，並自生效日起設立人民幣櫃台。因此，上市類別基金單位將自生效日起在香港聯交所以港幣、人民幣及美元進行交易。

多櫃台模式

投資人應注意，上市類別基金單位以子基金的基礎貨幣（即港幣）計值，而在一級市場增設新上市類別基金單位及贖回上市類別基金單位均以基礎貨幣結算。根據多櫃台安排，該等子基金將在聯交所提供三個交易櫃台（即港幣櫃台、人民幣櫃台及美元櫃台）供投資者用作二級交易之用。在港幣櫃台交易的上市類別基金單位將以港幣結算；在人民幣櫃台交易的上市類別基金單位將以人民幣結算；在美元櫃台交易的上市類別基金單位將以美元結算。除以不同貨幣結算外，由於每個櫃台均是不同且獨立的市場，因此不同櫃台的上市類別基金單位的交易價格可能有所不同。

根據增設申請增設及發行的上市類別基金單位最初可以作為港幣交易基金單位、人民幣交易基金單位或美元交易基金單位存入中央結算系統。參與證券商可根據與基金經理的安排，選擇在中央結算系統將上市類別基金單位存放於三個櫃台中的任意一個。同樣地，根據贖回申請贖回的上市類別基金單位可從任何交易櫃台（即港幣、人民幣或美元交易櫃台）提取。所有三個櫃台的上市類別基金單位均可透過參與證券商以贖回申請的方式贖回。

儘管採用多櫃台，(a) 在所有三個櫃台交易的上市類別基金單位屬於同一類別，並附有相同權利，且所有該等櫃台的所有基金單位持有人均受到平等對待；(b) 所有現金增設申請必須以基礎貨幣作出；及 (c) 參與證券商在現金贖回申請中收到的任何現金所得款項須僅以基礎貨幣支付。實物增設及贖回仍可依章程所述方式進行，且不會受到多櫃台安排的影響。

各櫃台的每手買賣數目及申請基金單位數目相同，華夏恒生香港生物科技指數 ETF 分別為 100 個基金單位及 200,000 個基金單位，而華夏恒生科技指數 ETF 則分別為 200 個基金單位及 200,000 個基金單位。

投資者應注意，各基金單位持有人將僅收取港幣分派（無論其持有港幣、美元或人民幣交易單位）。

股份代號及股份簡稱

該等子基金各櫃台將有不同的股份代號、股份簡稱及 ISIN 號碼，如下所示：

華夏恒生香港生物科技指數 ETF

櫃台	股份代號	股份簡稱（英文）	股份簡稱（中文）	ISIN 號碼
港幣	03069	CAM HSBIOTECH	華夏恒生生科	HK0000711199
人民幣	83069	CAM HSBIOTECH-R	華夏恒生生科-R	HK0000955887
美元	09069	CAM HSBIOTECH-U	華夏恒生生科-U	HK0000744208

華夏恒生科技指數 ETF

櫃台	股份代號	股份簡稱（英文）	股份簡稱（中文）	ISIN 號碼
港幣	03088	CAM HS TECH	華夏恒生科技	HK0000643327

人民幣	83088	CAM HS TECH-R	華夏恒生科技-R	HK0000955895
美元	09088	CAM HS TECH-U	華夏恒生科技-U	HK0000643335

跨櫃台轉換

一般情況下，投資者可於同一櫃台買賣上市類別基金單位，或在一個櫃台買入並在另一櫃台賣出，只要經紀人同時提供港幣、人民幣及／或美元交易服務並提供跨櫃台轉帳服務，支持多櫃台交易。即使交易發生在同一交易日內，也允許跨櫃台買賣。然而，投資人應注意，在不同櫃台買賣的上市類別基金單位的交易價格可能有所不同，且未必始終保持密切關聯，視乎市場供需及各櫃台流動性等因素而定。

如果投資者對多櫃台安排的費用、時間、程序和操作（包括跨櫃台轉換）有任何疑問，應諮詢其經紀人。

做市

與所有在香港聯交所上市的交易所買賣基金一樣，基金經理將確保各港幣及美元櫃台在任何時候均至少有一名做市商，並自生效日期起，人民幣櫃台亦有一名做市商（儘管這可能是同一個做市商）。基金經理將致力確保各櫃台至少具備一名做市商須至少提前三個月發出通知以終止相關做市安排。

各櫃台做市商名單，請參閱網站 www.hkex.com.hk。

多櫃台相關風險

該等子基金有多個櫃台交易的上市類別基金單位，即上市類別基金單位在人民幣櫃台以人民幣、在港幣櫃台以港幣及在美元櫃台以美元進行交易及結算。交易所買賣基金多櫃台的性質可能會使投資上市類別基金單位的風險高於單一櫃台基金單位或聯交所上市發行人股份的投資風險。例如，如果某一個櫃台的上市類別基金單位因任何原因在交易日的最後一刻才交付至中央結算系統，沒有預留足夠時間在當天進行跨櫃台結算，則該跨櫃台轉換結算失敗。

此外，如果因任何原因（例如營運或系統中斷）而暫停不同櫃台之間的上市類別基金單位的跨櫃台轉換，則基金單位持有人只能以相關多櫃台的貨幣交易其上市類別基金單位。因此，應該注意的是，跨櫃台轉換可能並不總是可用。

由於市場流動性、各櫃台的供求情況及匯率波動等不同因素，在某一櫃台交易的上市類別基金單位在聯交所的市場價格可能與在另一櫃台交易的上市類別基金單位在聯交所的市場價格存在較大差異。各櫃台的上市類別基金單位的交易價格由市場因素決定，因此不會與上市類別基金單位交易價格乘以當時外匯匯率。因此，當在某一櫃台買賣交易的上市類別基金單位時，如果相關上市類別基金單位的交易發生在另一櫃台，則投資者可能會較另一櫃台貨幣的等值金額收取較少或支付較多的金額。概無法保證各櫃台的上市類別基金單位價格相同。

沒有港幣帳戶的投資者只能買賣人民幣或美元交易的上市類別基金單位。然而，該等投資者將不能買賣港幣交易的上市類別基金單位，並應注意分派將僅以港幣進行。因此，該等投資者可能蒙受外匯損失，並在收取其分派時承擔外匯相關費用及收費。

部分經紀人及中央結算系統參與者可能並不熟悉或未能 (i) 在某一櫃台買入上市類別基金單位從而在另一櫃台賣出上市類別基金單位，或 (ii) 進行跨櫃台上市類別基金單位轉換，或 (iii) 同時在不同櫃台進行上市類別基金單位交易。在該情況下，可能需要使用另一名經紀人或中央結

算系統參與者。因此，投資者可能僅可以一種貨幣買賣其上市類別基金單位。建議投資者向其經紀人查詢多櫃台交易及跨櫃台轉換的準備狀態。

港幣分派風險

投資者應注意，如基金單位持有人持有在人民幣櫃台或美元櫃台交易的上市類別基金單位，相關基金單位持有人只會以港幣（而非人民幣或美元）獲取分派。倘相關基金單位持有人並無港幣賬戶，則該基金單位持有人可能須承擔有關將該分派由港幣兌換為人民幣、美元或任何其他貨幣的費用及收費。基金單位持有人應向其經紀人查詢有關分派的安排。

香港聯交所批准

香港聯交所已批准上市類別基金單位在人民幣櫃台進行交易，並自生效日期起生效。

印花稅

投資者在二級市場上就向其發行的上市類別基金單位（港幣、人民幣或美元交易單位）或由其贖回上市類別基金單位（港幣、人民幣或美元交易單位）或由其買賣上市類別基金單位（港幣、人民幣或美元交易單位）而言，無需繳納香港印花稅。

網站上的資料

自生效日期起，基金經理有關子基金的網站www.chinaamc.com.hk（該網站未經證監會審核）將會更新。特別是每個交易日近乎即時的每單位資產淨值以及最後收盤的每單位資產淨值也將以人民幣（除港幣及美元外）提供。前一天的收盤資產淨值將繼續僅針對港幣基金單位提供。

請注意，以人民幣及美元計值的接近實時估計每基金單位資產淨值及以人民幣及美元計值的最後收市每基金單位資產淨值僅供參考。

每基金單位以美元及人民幣計算的接近實時估計資產淨值由 ICE Data Indices 計算，使用接近實時的港幣指示性每基金單位資產淨值乘以 ICE Data Indices 即時外匯匯率所提供的即時美元：港幣外匯匯率或人民幣：港幣外匯匯率。由於接近實時的港幣指示性每基金單位資產淨值不會在相關股票收市時更新，因此在此期間以人民幣或美元計值的每單位指示性資產淨值（如有）的任何變動僅是由於外匯匯率。美元及人民幣接近實時估計每基金單位資產淨值乃按最新每基金單位港幣資產淨值乘以受託人提供的同一交易日下午 2 時（香港時間）路透社所報的美元：港幣匯率或人民幣：港幣匯率計算。以港幣計值的官方最後每基金單位資產淨值及以人民幣和美元計值的指示性每基金單位最後資產淨值將於香港聯交所開放交易日更新。

3. 該等子基金上市類別基金單位分派政策的變更

目前，上市類別基金單位不會從資本或實際上從資本中作出分派。分派僅從上市類別基金的淨收入中支付。自生效日期起，上市類別基金單位的分派政策將進行修訂，以便基金經理可酌情決定 (i) 從資本，或 (ii) 從總收入中作出分派，而上市類別基金單位的全部或部分費用及開支則從上市類別基金單位的資本中支取／撥付，導致上市類別基金單位的可分派收入有所增加以供上市類別基金單位作出分派，因此上市類別基金單位可實際上從資本中作出分派。作出該項變更的原因是為上市類別基金單位分派政策提供靈活性，並可為投資者提供穩定、持續的收入流。

從資本或實際上從資本中撥付分派的有關風險

從資本或實際上從資本中支付分派相當於退還或提取投資者部分原投資的金額或歸屬於該原本投資的資本收益。任何該等涉及從該等子基金資本或實際上從資本支付的分派可導致每上市類別基金單位資產淨值的即時扣減。

詳情請參閱章程「法定及一般資料」章節下的「分派政策」一節所述。

4. 華夏恒生科技指數 ETF 投資策略的變更

目前，子基金：

- (i) 除了從指數成分公司的公司行動所獲取的金融衍生工具外，無意投資於任何金融衍生工具；
- (ii) 不進行任何證券借貸交易；及
- (iii) 可將不超過資產淨值的 **5%**投資於貨幣市場工具和用於現金管理目的的現金存款。

自生效日期起，子基金的投資策略將會發生變更，以便：

- (i) 除從指數之成分公司的公司行動獲取以外，子基金可投資於金融衍生工具，包括但不限於作對沖或非對沖（即投資）用途的總回報指數掉期，並且子基金為非對沖（即投資）目的而持有的金融衍生工具將不超過子基金資產淨值的 **10%**；
- (ii) 子基金可進行證券借貸交易，最高為子基金資產淨值的 **50%**，預計最高為 **20%**；及
- (iii) 考慮到就證券借貸交易可能收取的現金抵押品，子基金可持有不超過其資產淨值 **50%** 的貨幣市場工具和現金存款用於現金管理目的。

對於證券借貸交易，基金經理可以隨時收回已借出的證券。所有證券借貸交易只會按照子基金的最佳利益並根據相關證券借貸協議的規定進行。基金經理可全權酌情隨時終止此類交易。

作為證券借貸交易的一部分，子基金必須收到相當於所借證券價值（包括利息、股息和其他最終權利）**100%**的現金和／或非現金抵押品。抵押品將每日按市值計算，並由受託人或受託人指定的代理人保管。收到的非現金抵押品不得出售、再投資或質押。收到的現金抵押品的任何再投資均應遵守子基金的章程附表 1「抵押品」小節中規定的要求。

倘子基金進行證券借貸交易，所有產生的收益（在適用的法律和監管要求允許的範圍內，在扣除直接及間接開支，以支付合理及正常補償予基金經理、證券借貸代理人及／或其他服務供應商因該等交易而提供的服務後）應退還予子基金。證券借貸交易的相關成本將由借款人承擔。

請參閱華夏恒生科技指數 ETF 章程附表 1，以了解基金經理有關金融衍生工具、抵押品和證券借貸交易的政策要求和概要。

投資策略變更的原因

將金融衍生工具及證券借貸交易納入投資策略的原因是為了加強有效的投資組合管理，並容許基金經理能夠透過參與金融衍生工具及證券借貸交易來維持子基金更大的投資彈性，以實現其投資目標。

投資策略變更帶來的額外風險

子基金將面臨與變更相關的額外風險，如下所示：

證券借貸交易風險

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、借出證券的價值變動，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，這可能導致子基金出現重大虧損。子基金也可能受到抵押品的流動性和託管風險以及執法的法律風險的影響。

營運風險 - 進行證券借貸交易，子基金須承受營運風險，例如延誤或未能結算。上述延誤或未能結算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。

與金融衍生工具和抵押品有關的風險

金融衍生工具是一種財務合約或工具，其價值取決於或衍生自相關資產（例如證券或指數）的價值，或會具有高度價格變動性，而且偶然會出現急速及重大的變化。與傳統證券相比，金融衍生工具對利率變動或市場價格的突發性波動更為敏感，因為其所需保證金金額較低，而且金融衍生工具定價涉及極高程度的槓桿比率。因此，衍生工具相對較小的價格變動，可能會導致子基金出現即時的巨額損失（或利潤）。子基金投資於金融衍生工具較其只投資於傳統證券可能蒙受更大的損失。

金融衍生工具也可能沒有活躍的市場，因此金融衍生工具的投資可以缺乏流動性。為了應付贖回要求，子基金或須依賴金融衍生工具發行人作出報價以便將金融衍生工具的任何部分平倉，以反映市場流動情況及交易的規模。

此外，很多金融衍生工具都沒有在交易所買賣。因此，從事金融衍生工具交易的子基金須承受與其交易的任何對手方無法或拒絕履行該等合約的風險，並因此子基金亦可能須蒙受其在金融衍生工具的權益全盤虧損的情況。此種風險亦會由於以下事實而加強：場外衍生工具市場一般不受政府部門監管，這些市場的參與人士無須為其買賣的合約締造持續的市場。

金融衍生工具的投資並不會使金融衍生工具持有人享有股份的實益權益，其對發行股份的公司亦不享有申索權。概不能保證金融衍生工具的價格會相等於該公司或其擬複製或取得反向或槓桿投資的證券市場的相關價值。

抵押品管理和抵押品再投資是存在風險的。收取到的任何抵押品價值可能會受到市場事件的影響。如果抵押資產是上市證券，則此類證券的上市可能會被暫停或撤銷，或者此類證券在證券交易所的交易可能會被暫停，在暫停期間或撤銷時，可能需要更長的時間才能完成實現相關抵押資產。對於作為債務證券的抵押資產，此類證券的價值將取決於發行人或債務人在有關抵押資產方面的信譽。如果此類抵押資產的任何發行人或債務人無力償債，則抵押資產的價值將大幅減少，並可能導致子基金在此類交易對手方的風險敞口不足。如果子基金對現金抵押品進行再投資，則存在投資風險，包括潛在的本金損失。

華夏恒生科技指數 **ETF** 的章程和產品資料概要中的風險披露將隨之更新。投資人務須考慮子基金的投資風險。

5. 其他更新

由生效日期起，除投資策略變更外，華夏恒生科技指數 **ETF** 的章程及產品資料概要亦會更新，以澄清：

- (i) 如果由於因受限制或數目有限而無法購買某些屬於指數成分股的證券，或在基金經理以絕對酌情權認為適當的情況下，基金經理也可以使用代表性抽樣策略；
- (ii) 基金經理亦會以絕對酌情權認為適當的情況下在完全複製策略和代表性抽樣策略之間進行切換，以便通過盡可能密切（或有效）跟蹤標的指數，實現華夏恒生科技指數 ETF 的投資目標，從而為投資者帶來利益；及
- (iii) 對於在證券借貸交易中可能作為抵押品收取的任何非現金抵押品，例如股本證券及固定收益證券，其持有的不屬於標的指數成分股的證券不得超過其資產淨值的 30%。

由生效日期起，華夏恒生香港生物科技指數 ETF 的章程及產品資料概要亦會更新，以澄清就證券借貸交易收取作為抵押品的任何非現金抵押品（例如股本證券及固定收益證券），其持有的不屬於標的指數成分股的證券不得超過其資產淨值的 30%。

為免生疑，以上是有關章程及產品資料概要的澄清，並非投資策略的重大變動。

該等子基金的章程及產品資料概要（視情況而定）也將進行更新，以反映與基金經理有關的某些資訊的更新，包括但不限於陽坤先生被任命為基金經理董事和基金經理其他董事的履歷的更新，以及其他雜項、編輯和行政變更。

6. 該等子基金引入非上市類別基金單位、增設人民幣櫃台、分派政策變更，以及華夏恒生科技指數 ETF 投資策略變更的影響

除因分派政策變更而導致從資本中或實際上從資本中支付分派相關的額外風險外，華夏恒生香港生物科技指數 ETF 的風險狀況並無因為引入非上市類別基金單位、分派政策變更或增設人民幣櫃台而發生重大變化。

除從資本或實際上從資本中支付分派、證券借貸交易、金融衍生工具和抵押品相關的額外風險外，華夏恒生科技指數 ETF 的整體風險狀況並無因為引入非上市類別基金單位、分派政策變更、投資策略變更或增設人民幣櫃台而發生重大變化。

除引入非上市類別基金單位、增設人民幣櫃台、分派政策變更及（就華夏恒生科技指數 ETF 而言）投資策略變更外，該等子基金的運作或管理方式不變，現有投資者也不會因此受到影響。

該等子基金引入非上市類別基金單位、增設人民幣櫃台、分派政策變更及（就華夏恒生科技指數 ETF 而言）投資策略的變更不會 (i) 對子基金現有投資者的權利或利益產生重大損害，或 (ii) 改變管理該等子基金的費用水平或成本。

該等子基金因引入非上市類別基金單位、增設人民幣櫃台、分派政策變更及（就華夏恒生科技指數 ETF 而言）投資策略的變更而產生的成本和／或開支將由該等子基金的上市類別基金單位和非上市類別基金單位承擔。華夏恒生科技指數 ETF 的預計費用約為港幣 20 萬（包含律師費及翻譯費），華夏恒生香港生物科技指數 ETF 的預計成本約為港幣 14 萬（包含法律費及翻譯費）。預計該等費用不會對該等子基金的資產淨值造成任何重大影響，亦不會對基金單位持有人產生任何重大不利影響。另外，此類費用不會對上市類別基金單位的經常性開支產生任何重大影響。

該等子基金引入非上市類別基金單位、增加人民幣櫃台、分派政策變更及（就華夏恒生科技指數 ETF 而言）投資策略的變更均無需基金單位持有人批准。受託人對變更沒有任何異議。

7. 一般事項

反映上述變更的該等子基金經更新的章程（包括產品資料概要）於生效日期起可在基金經理網站 www.chinaamc.com.hk（該網站未經證監會審核）和香港聯交所網站 www.hkex.com.hk 獲取。

投資者如對上述事宜有任何查詢，可於辦公時間內聯絡位於香港中環花園道 1 號中銀大廈 37 樓的基金經理，或可致電基金經理的查詢熱線（852）3406 8686。

華夏基金（香港）有限公司
作為本信託和該等子基金的基金經理
2023 年 12 月 19 日