

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（「**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 II **（「信託」）**

（根據香港《證券及期貨條例》（第 571 章）第 104 條獲認可的香港傘子單位信託）

華夏亞洲美元投資級別債券 ETF

港幣櫃台股份代號：3141

美元櫃台股份代號：9141

華夏亞洲高息股票 ETF

股份代號：3145

華夏 MSCI 日本股票（美元對沖）ETF

股份代號：3160

華夏 MSCI 歐洲優勢股票（美元對沖）ETF

股份代號：3165

華夏納斯達克 100 ETF

港幣櫃台股份代號：3086

美元櫃台股份代號：9086

（各自為「子基金」，統稱「該等子基金」）

公告

(1) 該等子基金引入非上市類別基金單位

(2) 該等子基金上市類別基金單位的派息政策之變更

(3) 華夏亞洲高息股票 ETF、華夏 MSCI 日本股票（美元對沖）ETF、華夏 MSCI 歐洲優勢股票（美元對沖）ETF 及華夏納斯達克 100 ETF 的金融衍生工具策略之變更

(4) 信託契據的修訂

華夏基金（香港）有限公司，作為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 12 月 23 日（「**生效日期**」）起生效：

- (1) 該等子基金將引入包含波動定價機制的非上市類別基金單位（「**非上市類別基金單位的引入**」）；
- (2) 該等子基金上市類別基金單位（「**上市類別基金單位**」）的派息政策將作出變更，以便基金經理酌情決定，上市類別基金單位可從資本中或實際從資本和收入中支付分派（「**派息政策之變更**」）；以及
- (3) 華夏亞洲高息股票 ETF、華夏 MSCI 日本股票（美元對沖）ETF、華夏 MSCI 歐洲優勢股票（美元對沖）ETF 及華夏納斯達克 100 ETF 的金融衍生工具（「**金融衍生工具**」）的策略將作出變更，因此該等子基金可就對沖或非對沖（即投資）目的投資於包括但不限於期貨和總回報指數掉期的金融衍生工具。各子基金因非對沖（即投資）目的而持有的金融衍生工具將不超過其資產淨值（「**資產淨值**」）的 10%（「**金融衍生工具策略之變更**」）。

除非在本公告中另有界定，本公告所用詞彙與信託及該等子基金的基金章程（「**基金章程**」）已界定者具有相同涵義。

1. 各子基金引入非上市類別基金單位

在生效日期，各子基金將引入非上市類別基金單位，為投資者認購各子基金基金單位提供一個額外選擇。基金經理預期引入非上市類別基金單位將分別增加該等子基金的規模。透過非上市類別基金單位，投資者可以按照各子基金各自的資產淨值直接或通過分銷商認購／贖回各子基金。

該等子基金的非上市類別基金單位（「**非上市類別基金單位**」）將包含波動定價機制。非上市類別基金單位引入波動定價機制是為了保護投資者免受因非上市類別基金單位的重大淨認購或淨贖回而產生的交易成本所造成的攤薄。

上市類別基金單位與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。基金章程將於生效日期修訂。投資者應參閱經修訂的基金章程以及分別與該等子基金相關的附件（特別是各附件中的「**主要資料**」部份），以獲取有關上市類別基金單位與非上市類別基金單位之間異同的資料。

各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修訂，各子基金非上市類別基金單位獨立的產品資料概要亦將於生效日期發行。

與上市類別和非上市類別基金單位之間的交易、費用和成本安排差異相關的風險

不同的交易安排

各子基金是交易所買賣基金，提供上市類別基金單位和非上市類別基金單位。上市類別基金單位和非上市類別基金單位的交易安排不同，以及根據市場情況，上市類別基金單位的投資者可

能較非上市類別基金單位的投資者更具優勢，或相反亦然。各上市類別基金單位和非上市類別基金單位的每單位資產淨值也可能不同，因為適用於各類別基金單位的費用（如管理費）和成本不同。

不同的成本機制

此外，投資者應注意，不同的成本機制應用於上市類別基金單位和非上市類別基金單位。就上市類別基金單位而言，有關增設及贖回申請的交易費和稅項及收費由申請或贖回該等基金單位的參與證券商及／或基金經理支付。二級市場內上市類別基金單位的投資者將不承擔此類交易費和稅項及收費（但為免疑義，或會承擔其他費用，如基金章程「費用及開支」部份所述的聯交所交易費）。

另一方面，認購及贖回非上市類別基金單位可能需要分別繳付認購費及贖回費，該費用將由認購或贖回的投資者支付予基金經理。此外，基金經理可全權酌情決定，除認購價及／或贖回價以外，在某些情況下，增加或扣減其認為代表相關子基金通常招致之交易費用或開支的適當撥備的認購調整津貼或贖回調整津貼（視情況而定），而該等額外款項將支付予信託人，並將構成相關子基金資產的一部分。有關認購調整津貼和贖回調整津貼的更多資料，請參閱基金章程中的附表二。此外，基金經理可以（如果其真誠地認為符合基金單位持有人的最佳利益）通過波動定價機制，調整該等基金單位的資產淨值，以確保非上市類別基金單位的投資者不會因重大淨認購或淨贖回而受到損害。請參閱基金章程附表三內「反攤薄定價調整」部份的詳細資料。

任何或所有此等因素均可導致上市類別基金單位與非上市類別基金單位的資產淨值的不同。

有關非上市類別基金單位的交易安排

與上市類別基金單位的投資者可以於聯交所交易時段內在二級市場買賣基金單位不同，非上市類別基金單位的投資者只可以以基礎於每個交易日日終最新可用的資產淨值計算所得的相關認購價和贖回價（視情況而定）認購和贖回。因此，上市類別基金單位的基金單位持有人可能會有日內交易的機會而非上市類別基金單位的基金單位持有人將未能獲得。在受壓市況下，如果市場持續惡化，上市類別基金單位的基金單位持有人可以於聯交所交易時段內在二級市場沽售基金單位，而非上市類別基金單位的基金單位持有人將不能如此操作。

有關上市類別基金單位的交易安排

相反，二級市場投資者通常無法獲得非上市類別基金單位投資者可用的贖回便利。在受壓市況下，參與證券商可自行或代表任何一級市場投資者按子基金的資產淨值在一級市場上贖回的上市類別基金單位，但二級市場交易價格則可能偏離相應的資產淨值。在這種情況下，二級市場上的上市類別基金單位的基金單位持有人將明顯較非上市類別基金單位的基金單位持有人處於劣勢，因為後者將能夠按照資產淨值從子基金贖回，同時前者將不能。

不同的派息政策

基金經理將向上市類別基金單位的基金單位持有人支付分派和可能向非上市派息類別基金單位的基金單位持有人（但不是向非上市累積類別基金單位的基金單位持有人）支付分派。向上市類別基金單位和非上市派息類別基金單位作出分派可能導致該等相關每單位資產淨值的即時扣減。非上市累積類別基金單位收取的所有收益和資本增值將被再投資以及在每單位資產淨值反映。基金類別不同的派息政策將導致基金類別資產淨值的不同。

波動定價機制（只適用於非上市類別基金單位）

當子基金的所有非上市類別基金單位出現相關重大淨認購或淨贖回時，基金經理可能（如果其真誠地認為符合基金單位持有人的最佳利益）透過波動定價機制調整子基金的非上市類別基金

單位的基金單位的資產淨值。因此，投資者可能以較高認購價／較低贖回價認購／贖回。投資者應注意，可能引發波動定價調整事件的發生是不可預測的。概無法準確預測將需要進行此類波動定價調整的頻率。波動定價調整可能高於或低於實際產生之費用。投資者亦應注意，波動定價調整可能並不能總是或完全防止子基金資產的攤薄。

2. 該等子基金上市類別基金單位的派息政策之變更

目前，上市類別基金單位不會從資本中或實際上從資本中支付分派。分派僅從上市類別基金單位的淨收入中支付。自生效日期起，上市類別基金單位的分派政策將進行修訂，以便基金經理可以酌情決定 (i) 從資本支付分派，或 (ii) 從總收入中支付分派，同時從上市類別基金單位的資本中扣除／支付全部或部分上市類別基金單位的費用和開支，導致上市類別基金單位支付分派的可供分派收入增加，因此，上市類別基金單位可實際上從資本中支付分派。這項變更的原因是為了提供上市類別基金單位分派政策的彈性。

從資本或實際從資本中支付分派的風險

基金經理可按其酌情從上市類別基金單位的資本中支付分派。基金經理亦可按其酌情從總收入中支付分派，同時全部或部分上市類別基金單位的費用和開支從上市類別基金單位的資本中扣除／支付，導致供子基金支付分派的可供分派收入有所增加，子基金因此可實際上從資本中支付分派。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本投資的金額或歸屬於該金額的資本收益。任何該等分派可導致子基金的每上市類別基金單位資產淨值的即時扣減。詳情請參閱本基金章程「法定及一般資料」部份下題為「派息政策」一節所述。

3. 華夏亞洲高息股票 ETF、華夏 MSCI 日本股票（美元對沖）ETF、華夏 MSCI 歐洲優勢股票（美元對沖）ETF 及華夏納斯達克 100 ETF 的金融衍生工具策略之變更

目前，華夏亞洲高息股票 ETF、華夏 MSCI 日本股票（美元對沖）ETF、華夏 MSCI 歐洲優勢股票（美元對沖）ETF 及華夏納斯達克 100 ETF（「受金融衍生工具策略影響子基金」）無意出於對沖或非對沖目的投資於任何金融衍生工具（即受金融衍生工具策略影響子基金不會出於任何目的使用衍生工具）。

自生效日期起，各受金融衍生工具策略影響子基金的金融衍生工具策略將會作出變更，以便受金融衍生工具策略影響子基金可以投資於包括但不限於總回報指數掉期的金融衍生工具，不論出於對沖或非對沖（即投資）目的，以及出於非對沖（即投資）目的的金融衍生工具持有量將不超過相關受金融衍生工具策略影響子基金資產淨值的 10%。為避免疑義，各受金融衍生工具策略影響子基金的衍生工具淨敞口最多可達其資產淨值的 50%。

金融衍生工具策略的變更將使基金經理能夠透過參與金融衍生工具為受金融衍生工具策略影響子基金維持更大的投資靈活性，從而實現其投資目標。

與金融衍生工具相關的風險

金融衍生工具是一種金融合約或工具，其價值取決於或衍生自相關資產（例如證券或指數）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，由於所需保證金存款較低且定價中涉及極高程度的槓桿，金融衍生工具對利率變化或市場價格突然波動更為敏感。因此，金融衍生工具相對較小的價格變動可能會導致受金融衍生工具策略影響子基金即時遭受重大損失（或利潤）。受金融衍生工具策略影響子基金如果投資於金融衍生工具較其僅投資於傳統證券可能蒙受更大損失。

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能缺乏流動性。為滿足贖回請求，受金融衍生工具策略影響子基金可依賴金融衍生工具發行人作出以便將金融衍生工具的任何部分平倉，該價格將反映市場流動狀況和交易規模。

此外，許多金融衍生工具不在交易所進行交易。因此，如果相關受金融衍生工具策略影響子基金從事涉及金融衍生工具的交易，則其將面臨與相關受金融衍生工具策略影響子基金進行交易的對手方無法或拒絕履行該等合約的風險，以及因此，受金融衍生工具策略影響子基金可能會遭到受金融衍生工具策略影響子基金於金融衍生工具權益的全部損失。由於場外衍生工具市場一般不受政府當局監管，而該等市場的參與者無需為在其交易合約中締造持續的市場，此情況亦加劇了上述風險。

金融衍生工具的投資並不會使金融衍生工具持有人有權獲得股票的實益權益，也不能向發行股份的公司提出任何索賠。概無法保證金融衍生工具的價格將等於其可能尋求複製或獲得風險敞口的公司或證券市場的相關價值。

基金章程的附件和受金融衍生工具策略影響子基金相關的產品資料概要將分別進行相應更新。投資者應考慮投資受金融衍生工具策略影響子基金的風險。

4. 引入非上市類別基金單位、派息政策之變更和金融衍生工具策略之變更的影響

除本文所披露外，各子基金的投資目標和策略保持不變，該等子基金的風險概況不會發生重大變化或增加。

除本文所披露外，子基金的運作或管理方式並無因此而改變。除本文所述外，基金經理預計非上市類別基金單位的引入、派息政策的變更以及金融衍生工具策略的變化不會影響上市類別基金單位的運作或管理方式。

引入非上市類別基金單位、派息政策的變更以及金融衍生工具策略的變更不會 (i) 嚴重損害子基金現有投資者的權利或權益，或 (ii) 改變管理上市類別基金單位的費用水平或成本。

引入非上市類別基金單位及更改派息政策所產生的成本及／或開支預計為港幣 270,000 元（包括律師費及翻譯費）。由於所有子基金均採用單一管理費結構，因引入非上市類別基金單位及派息政策變更而產生的成本及／或開支將計入各子基金的管理費中。因此，不會向子基金收取任何額外成本和／或開支。預計這些成本不會對子基金的淨值造成任何重大影響，也不會對單位持有人產生任何重大不利影響。預計這些成本不會對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。

如現有投資者在上述變更生效日期或之後不欲繼續投資子基金的上市類別基金單位，可於生效日期前隨時在聯交所賣出其所持單位。有關在聯交所上交易基金單位的常規應付費用將適用。

子基金更新後的基金章程（包括各上市類別基金單位和非上市類別基金單位的產品資料概要）將於生效日期起在基金經理的網站 www.chinaamc.com.hk（本網站未經證監會審核）及聯交所網站 www.hkex.com.hk 可供查閱。

5. 信託契據的修訂

信託契據將於生效日期就有關該等子基金上市類別基金單位和非上市類別基金單位的交易和運作條款的變更作出進一步修訂和重述。根據信託契據和適用的法律及規定，信託契據的修訂毋須基金單位持有人批准。信託人同意信託契據的修訂。

經修訂和重述的信託契據之副本將可於辦公時間內在基金經理位於香港中環花園道 1 號中國銀行大廈 37 樓的辦公室免費索取查閱。

對上述所載有任何疑問的投資者可以在辦公時間內聯絡辦公室位於香港中環花園道 1 號中國銀行大廈 37 樓的基金經理，或致電查詢熱線（852）3406 8686。

華夏基金（香港）有限公司

作為信託和該等子基金之基金經理
2024年11月21日