

產品資料概要

嘉實中國可持續生活科技主動型 ETF

嘉實基金系列（香港）交易所買賣基金開放式基金型公司的子基金

發行人：嘉實國際資產管理有限公司

2022年9月15日



本產品為主動型交易所買賣基金。

本概要旨在為閣下提供有關本產品的主要資料。

本概要為章程的一部分。除非另有說明，否則本概要中使用但未另行界定的術語與章程中的涵義相同。

閣下不應單憑本概要投資於本產品。

資料便覽

| | |
|----------------------|--|
| 股份代號： | 3155 |
| 每手買賣股份數目： | 50 股 |
| 管理人及 QFII/RQFII 持有人： | 嘉實國際資產管理有限公司 |
| 投資顧問： | 華興證券（香港）有限公司 |
| 託管人： | 滙豐機構信託服務（亞洲）有限公司 |
| 中國託管人： | 滙豐銀行（中國）有限公司 |
| 行政管理人及登記處： | 香港上海滙豐銀行有限公司 |
| 全年經常性開支比率#： | 2% |
| 基礎貨幣： | 港元 |
| 交易貨幣： | 港元 |
| 股息政策： | 管理人擬每年（通常於每年 10 月）在計及子基金的淨收益（扣除費用及成本）後向股東作出分派。股份的所有分派將以港元進行。概不會從資本中或實際上從資本中支付分派。 |
| 本基金的財政年度年結日： | 12 月 31 日 |
| ETF 網站： | http://etf.harvestglobal.com.hk |

本基金是甚麼產品？

嘉實中國可持續生活科技主動型 ETF（「子基金」）是嘉實基金系列（香港）交易所買賣基金開放式基金型公司（「公司」）的子基金，其乃根據香港法例成立，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公眾傘子開放式基金型公司。

子基金屬於《單位信託及互惠基金守則》第 8.10 章所界定的主動型管理交易所買賣基金。子基金的股份（「股份」）猶如股票般於香港聯合交易所有限公司（「香港聯交所」）買賣。

由於子基金為新成立，此僅為指示性數據。估計經常性開支比率為於 12 個月期間內向子基金收取的估計經常性開支，佔子基金於同期間的估計平均資產淨值的百分比表示。實際數字可能與估計有所不同，且每年均可能有所不同。自推出子基金起計 12 個月期間，經常性開支比率以子基金平均資產淨值的 2% 為上限。於此期間內超出子基金平均資產淨值的 2% 的任何經常性開支將由管理人承擔，並不會向子基金收取。

目標及投資策略

目標

子基金的投資目標乃透過主要投資於直接或間接參與提供生活科技產品及/或服務（「生活科技」），並符合注重環境、社會及管治（「ESG」）投資原則的公司，實現長期資本增長。概不保證子基金能實現其投資目標。

策略

為實現子基金的投資目標，子基金將主要（即其資產淨值（「資產淨值」）的至少 70%）投資於在中國內地、香港及/或美國上市的股票及/或等同股票的證券，該等股票及/或等同股票的證券乃由(i)總部或註冊地在中國內地、香港或澳門的公司，(ii)直接或間接參與提供生活科技產品及/或服務（「生活科技要求」）及(iii)具有可持續性業務經營方式的 ESG 領導者，即根據下文「ESG 選擇」分節釐定為在投資領域內就 ESG 綜合得分、氣候變化得分或社會平等得分的一項或多項中排名前三分之一的公司（「ESG 領導者」）所發行。

具有可持續業務經營方式的公司是指其營運及商業策略融合了防止自然或物理資源耗竭的措施或考慮到相關需要，以便該等資源能夠長期保持可用。氣候變化及社會平等最能體現可持續性的概念。在氣候變化方面，防止氣候變化是環境保護的核心目標之一，其與可持續性緊密相連，確保地球的資源不會被耗盡。在社會平等方面，在社會平等方面排名前列的公司往往亦會採取可持續的業務經營方式，因為促進或考慮到社會共融的公司通常亦有助於社會的經濟發展及環境保護，從而促進可持續性。

子基金將通過管理人的合格境外投資者（「QFII/RQFII」）身份及/或「股票市場交易互聯互通機制」直接於中國內地境內證券市場投資A股。股票市場交易互聯互通機制是一項證券交易和清算掛鈎計劃，旨在實現中國內地和香港之間的相互股票市場准入，由滬港通和深港通組成。管理人可透過QFII/RQFII投資子基金最多30%的資產淨值，並透過股票市場交易互聯互通機制投資子基金最多50%的資產淨值，包括投資於在創業板市場和/或科技創新板（「科創板」）上市的證券。就子基金投資的發行人的市值而言沒有任何限制。子基金可投資於小型及中型資本公司。然而，子基金將不會投資於在北京證券交易所上市的A股股票。

為免生疑問，子基金亦可不時將不超過其資產淨值的 20%投資於符合投資目標的股票及/或等同股票證券，該等股票及/或等同股票證券的發行人符合生活科技要求，且為 ESG 領導者，但(i)在中國內地、香港及/或美國以外的市場上市；或(ii)總部或註冊地在中國內地、香港及/或澳門以外的全球市場。

生活科技

生活科技指為應對消費和技術領域的新趨勢而開發的新產品類型及/或服務。生活科技可能來自於，例如產品或服務的高端化；醫療保健、娛樂、旅遊、體育及健身方面的產品或服務需求的增加；線上消費滲透率上升，以及技術及相應供應鏈的發展以實現上述事項。

直接或間接參與生活科技業務的公司可能包括但不限於涉及以下主題的公司：休閒（如零售及服裝）；數碼技術（如雲端運算服務）；交通（如自動駕駛）；技術硬體（如半導體）；和金融科技（如線上融資平台）。間接參與生活科技業務的公司可以向與生活科技業務直接相關的公司提供輔助服務。例如，對於與自動駕駛有關的生活科技業務，輔助服務的例子是開發及提供充電站和軟件服務。

ESG 選擇

子基金的投資領域包括滿足上述生活科技要求的公司所發行的股票及/或等同股票證券，並在中國內地、香港及/或美國以及若干其他環球市場，即新加坡、東京、法蘭克福、倫敦、韓國、台灣及/或澳洲上市。

為實現子基金的 ESG 目標，子基金採用多方面的系統性 ESG 整合過程，結合 ESG 負面篩選及積極擁有權等方式，持續不斷選擇最佳的 ESG 領導者。上述程序將應用於子基金的所有潛在投資。

子基金可將少於 30%的資產淨值投資於在所有三個 ESG 考慮因素（即 ESG 綜合得分、氣候變化得分及社會平等得分）方面在投資範圍中排名較低的三分之二的發行人，只要這些發行人(i)在 ESG 綜合得分、氣候變化得分及社會平等得分以外的 ESG 方面有強勁表現，或(ii)在 ESG 綜合表現、氣候變化及社會平等考慮因素中的一個或多個方面，有強勁的改善趨勢或強勁的改善潛力，尤其是在管理人與該等發行人進行溝通後。

多方面的系統性 ESG 整合過程

多方面的系統性 ESG 整合過程可大致分為以下的定量及定性元素：

- 定量評估乃基於自身開發的嘉實 ESG 評分方法（於章程中進一步描述），該方法乃參考全球公認的 ESG 框架建構，如可持續發展會計標準委員會及全球報告倡議組織開發的框架。為建立一個客觀、透明及一致的評分系統，該方法乃由量化數據驅動及以規則為本。管理人的定量評估包括維持一個排除資料庫，進行按照規範的排除工作（即篩選出不符合廣泛接受的規範的公司，例如聯合國全球契約十項原則），以及根據 ESG 評分創建高績效 ESG 證券籃子。
- 定性評估將由 ESG 分析員及投資分析員合作進行。定性評估強調公司在近期及長期內的 ESG 動能，並輔助補充定量評估（定量評估乃依賴歷史資料）。管理人的定性評估包括評估可衡量的 ESG 影響及業績改善，以及採用積極擁有權理念。

管理人亦對個別公司進行部分為定量及部分為定性的深入研究。

經進行上述評估後，在投資領域中 ESG 排名前三分之一的公司可能會被子基金選中進行投資。

對氣候變化及社會平等表現的單獨評估

管理人之後會對子基金所有的潛在投資重複進行上述評估，但評估重點在於氣候變化及社會平等方面。管理人在評估發行人的表現時，會考慮氣候變化及社會平等主題下的個別議題，其中包括但不限於碳排放強度、社區發展及貢獻、人力資本發展、員工平均工資及員工福利。然後將根據氣候變化及社會平等對發行人進行排名。

除按照規範進行排除之外，違反若干氣候變化及社會平等關鍵原則的發行人將被排除在投資之外，例如，違反氣候變化及/或社會平等的國際原則及規範的公司（包括但不限於國際勞工組織的法律），以及參與有爭議的業務和行業的公司，而該等業務的營業額超過預設門檻（如煙草業務佔營業額超過 5%）。詳情請參閱章程。

其他限制

子基金可將其資產淨值的最多 20% 投資於金融衍生工具，用於投資及對沖。子基金可借入不超過其資產淨值的 10%，用於投資及流動性管理。

子基金可將不超過其資產淨值的 20% 投資於可交割或毋須交割的遠期合約、貨幣期權及貨幣期貨（在中國內地以外的地方進行離岸交易），用於對沖及投資。子基金亦可以購買在中國內地或離岸市場交易的股指期貨，用於對沖及投資。除上述披露外，管理人目前不打算投資於衍生工具。

子基金亦可將其資產淨值的少於 30% 投資於第二上市及境外上市證券，如美國存托憑證（「美國存托憑證」）。

管理人可代表子基金進行證券借貸交易、銷售及回購交易、反向回購交易或類似的場外交易，最高可達子基金資產淨值的 50%，而預期水平約為子基金資產淨值的 25%。詳情請參閱章程。

子基金的投資策略受章程第一部分所載的投資及借貸限制所規限。

基準

子基金為主動管理。管理人為衡量其表現，並讓投資者以更客觀的方式評估子基金的投資表現，擬參考與子基金具有相似投資領域的基準，即 Solactive China Lifestyle Tech Index（「基準」）。詳情請參閱章程。

衍生工具的使用/衍生工具投資

子基金的衍生工具風險承擔淨額最高為其資產淨值的 50%。

本基金有哪些主要風險？

投資涉及風險。請參閱章程，以了解風險因素等資料。

1. 投資風險

- 子基金的投資組合價值可能因下列任何主要風險因素而下跌，故閣下於子基金的投資可能蒙受損失。概不保證可退還本金。

2. 股票市場風險

- 子基金的股本證券投資須承受一般市場風險，該等投資的價值可能受多項因素影響而波動，例如投資情緒、政治和經濟狀況的轉變，以及發行人特定因素。

3. 主動投資管理風險

- 子基金採用積極管理的投資策略。子基金並不擬跟蹤或複製任何指數或基準，管理人亦不會進行複製或代表性抽樣。子基金或會因管理人的投資選擇，及/或執行可能導致子基金與其他具有類似目標的指數追蹤基金相比表現不佳的程序而未能實現其目標。

4. ESG 投資政策風險

- 使用 ESG 標準可能影響子基金的投資業績。例如，子基金投資政策中使用的基於 ESG 的排除性標準可能導致子基金放棄購買某些本來有利的證券的機會。因此，與非使用此類 ESG 標準的類似基金相比，子基金的表現可能有所不同。在根據 ESG 標準評估證券或發行人時，管理人依賴來自公開資料的資訊及數據，該等資訊及數據可能不完整、不準確、不一致或不可用。此外，由於市場尚未出現標準化的 ESG 類標準，對證券的 ESG 特徵的評估及證券的選擇可能涉及管理人的主觀判斷，其判斷可能不準確。
- 子基金持有的證券可能受到風格轉移的影響，在進行此類投資後或不再符合子基金的 ESG 投資方法，這意味著管理人可能需要出售此類證券，從而導致子基金的資產淨值下降。子基金亦可能集中於關注 ESG 的公司，其價值可能較擁有更多樣化投資組合的基金更不穩定。

5. 生活科技行業風險

- 子基金主要投資於特定行業或板塊會帶來行業或板塊風險。由於子基金在生活科技以外的行業或板塊的分散程度降低，子基金可能更容易受到與生活科技行業相關因素的影響。
- 生活科技行業的風險包括但不限於該等較小或有限的證券市場，因而可能會降低證券的流動性；由於對零售及消費市場的依賴，其相對更易受商業週期及消費需求變化影響；而對科技進步的高度依賴也因此增加被快速淘汰的風險；以及與技術及消費行業相關的政策風險。
- 子基金可能投資於生活科技行業內具有同股不同權（「同股不同權」）及/或屬於可變利益實體（「可變利益實體」）的公司。投資於同股不同權公司可能會導致股東權利、公司管治及投資者保障方面的問題。中國內地當局亦可能整體地對可變利益實體採取監管行動，甚至宣佈可變利益實體為非法，這將對可變利益實體的價值以及子基金的資產淨值產生不利影響。

6. 與地域集中、中國內地及新興市場有關的風險

- 子基金的投資集中於中國內地、香港或澳門設立總部或註冊的公司。子基金的價值可能較投資組合更多樣化的基金更容易波動。
- 尤其投資於新興市場（如投資於中國內地相關公司及中國內地市場）涉及某些在投資於較發達經濟體或市場時通常不會涉及風險及特殊考慮因素，例如高度波動的可能性以及較大的政治、稅務、經濟、外匯/貨幣管制、流動性、託管、結算、法律及監管風險。
- 子基金的價值亦可能更容易受到影響中國內地、香港及澳門市場的不利經濟、政治、政策、外匯、流動性、稅務、法律或監管事件的影響。

7. 與中小市值公司有關的風險

- 中小市值公司的股票可能具有較低的流動性，其價格比一般較大市值的公司的股票更容易受不利經濟發展的影響而波動。

8. 與通過 QFII/RQFII 制度及與股票市場交易互聯互通機制作出投資相關的風險

- 子基金進行相關投資以全面實施或追求其投資目標及策略的能力受中國內地適用法律、規則及法規（包括投資限制及本金及溢利的調回限制）所限制，該等限制可能出現變化且變化可能具有追溯力。倘 QFII/RQFII 身份的準予被撤銷/終止或因其他原因失效而子基金可能被禁止買賣相關證券及將子基金的資金調回，或倘任何主要營運方或有關方破產、違約及/或被取消履行其責任的資格，子基金或會蒙受重大損失。
- 股票市場交易互聯互通機制的相關規則及法規可能會變更，而有關變更可能具有潛在追溯效力。子基金通過該計劃進行投資的能力將因額度限制或暫停交易受到不利影響。
- 如果子基金通過股票市場交易互聯互通機制進行投資的能力受到不利影響，管理人將只能依靠 QFII/RQFII 投資來實現子基金的投資目標，反之亦然。

9. 與中國創業板市場及/或科創板相關的風險

子基金可投資於中國創業板市場及/或科創板，惟可能存在以下風險：

- **股價波動及流動性風險較高：**中國創業板市場及/或科創板的上市公司通常屬新興性質，營運規模較小。特別是與其他板塊相比，中國創業板市場及科創板的上市公司受到更大的價格波動限制，並且由於投資者的入門門檻較高，流動性有限。因此，相對於主板上市公司，該等板塊上市公司的股價波動及流動性風險較大，風險及周轉率較高。
- **估值過高風險：**於中國創業板市場及/或科創板上市的股票估值可能過高，且該等過高估值未必能持續。由於流通股較少，股價可能更易受操控影響。
- **法規差異：**與主板上市公司相比，涉及中國創業板市場及科創板上市公司的規則及法規在盈利能力及股本方面較不嚴格。
- **除牌風險：**於中國創業板市場及/或科創板上市的公司可能較經常及較快被除牌。倘子基金投資的公司被除牌，可能會對其造成不利影響。
- **集中風險：**科創板為新設立板塊，且在初始階段可能只有少量上市公司。於科創板的投資可能集中於少數股票，而子基金須承受更高的集中風險。

10. 與中國內地 A 股市場相關的風險

- A 股市場的高市場波動性及潛在結算困難可能導致於該等市場交易的證券價格出現大幅波動。中國內地的證券交易所一般有關暫停或限制在相關交易所進行的任何證券交易。政府或監管機構亦可能實施可能影響金融市場的政策。上述各種情況均可能對子基金資產淨值造成負面影響。
- 子基金可投資中國內地對外資擁有權或持股施加局限或限制的證券。該等法律及監管限制或會對子基金持股的流動性及表現造成不利影響。

11. 中國內地的稅項風險

- 根據專業及獨立的稅務建議，管理人目前並無為買賣 A 股（通過股票市場交易互聯互通機制或 QFII/RQFII）、在創業板市場及/或科創板上市的股票以及 H 股所產生的已變現或未變現的資本收益總額作出預扣所得稅撥備及增值稅撥備。
- 中國內地現行的稅收法律、法規及慣例對於通過 QFII/RQFII 或股票市場互聯互通機制在中國內地投資而變現的資本收益存在風險及不確定性（可能具有追溯效力）。對子基金增加的任何的稅務責任可能對子基金的資產淨值產生不利影響。如果子基金在未來被徵收稅款，而子基金並無就此作出撥備，子基金的資產淨值將受到不利影響。於此情況下，當時及其後的投資者將處於不利地位，因為彼等將承擔較在子基金投資時為高的稅務責任。

12. 人民幣的貨幣風險

- 子基金的相關投資可能以人民幣計值。人民幣目前不能自由兌換，並受到外匯管制及限制。子基金的資產淨值可能因人民幣與子基金的基礎貨幣（即港元）之間的匯率波動以及外匯管制的變化而受到不利影響。人民幣的任何貶值都會對股東在子基金的投資價值產生不利影響。儘管離岸人民幣（CNH）及在岸人民幣（CNY）是同一種貨幣，兩者具有不相同的匯率。CNH 及 CNY 之間的任何差異均可能對投資者產生不利影響。此外，在特殊情況下，以港元支付的贖回及/或分派的股息可能會因適用於人民幣的外匯管制及限制而延遲。

13. 與證券借貸、出售及回購及/或反向回購交易有關的風險

- *與證券借貸交易有關的風險*：如借用人無法按時歸還借出證券以及抵押品的價值比借出證券的價值為低時，證券借貸交易會承受風險。
- *與銷售及回購交易有關的風險*：倘接收抵押品存放的對手方失責，子基金可能在收回所存放抵押品時受到延誤，或因抵押品定價不準確或市場波動而使原先收取的現金少於存放在對手方的抵押品而蒙受損失。
- *與反向回購交易有關的風險*：倘接收現金存放的對手方失責，子基金可能在收回所存放現金時受到延誤，或難以將抵押品變現，或因抵押品定價不準確或市場波動而使出售抵押品所得款項可能少於存放在對手方的現金而蒙受損失。

14. 交易風險

- 股份於香港聯交所的交易價格受股份的供求情況等市場因素影響。因此，股份的交易價格可能會較子基金的資產淨值出現大幅溢價或折讓。
- 由於投資者於香港聯交所買賣股份時將支付若干費用（如交易費及經紀費），投資者於香港聯交所購買股份時支付的金額可能超過每股資產淨值，而於香港聯交所出售股份時收取的金額可能低於每股資產淨值。

15. 交易差異風險

- 由於上交所及深交所可能於子基金之股份尚未定價時開市，子基金投資組合內的證券價值在投資者無法買賣子基金股份的該等日子可能會有所變動。
- 境外證券交易所（即上交所及深交所）與香港聯交所的交易時段不同，因而可能擴大股份價格與其資產淨值之間的溢價或折讓水平。
- A 股須受交易區間限制，即限制成交價的升跌幅度，而於香港聯交所上市的股份則無此限制。此項差異亦可能擴大股份價格與其資產淨值之間的溢價或折讓水平。

16. 依賴莊家

- 雖然管理人將盡其最大努力訂立安排，以令至少有一名莊家為股份維持市場運作，且至少有一名莊家須在終止有關莊家活動安排前根據相關莊家協議發出不少於三個月的通知，倘若股份並無莊家，則股份的市場流通性或會受到不利影響。概不保證任何莊家活動將會有效。

17. 終止風險

- 子基金或會於若干情況下遭提前終止，例如當子基金總值下跌至低於組成文件及發售文件所載明的預定資產淨值數額。當子基金被終止時，投資者可能無法收回其投資及蒙受損失。投資者應參閱章程中的「終止（清盤除外）」一節以了解更多詳情。

基金過往的業績表現如何？

由於子基金為新成立的基金，故並無足夠數據為投資者提供有用的往績指標。

子基金是否提供保證？

子基金不設任何保證。閣下可能無法收回所投資的全數金額。

有何費用及收費？

請參閱章程的「費用及開支」一節，以了解其他費用及開支詳情。

閣下在香港聯交所買賣子基金時須支付的收費

| 費用 | 閣下支付的金額 |
|------------------|-----------------------|
| 經紀費 | 市場費率 |
| 交易徵費 | 0.0027% ¹ |
| 財務匯報局（「財匯局」）交易徵費 | 0.00015% ² |
| 香港聯交所交易費 | 0.005% ³ |
| 印花稅 | 無 |

1. 股份交易價格 0.0027% 的交易徵費，由買賣雙方支付。
2. 股份交易價格的 0.00015% 的財匯局交易徵費，由買賣雙方支付。
3. 股份交易價格的 0.005% 的交易費，由買賣雙方支付。

子基金應持續支付的費用

以下支出將由子基金支付，由於該等支出會令子基金的資產淨值下降，並可能影響交易價，因此對閣下造成影響。

| | 每年收費率（佔子基金資產淨值的%） |
|---|-----------------------|
| 管理費* 子基金向管理人支付管理費。 | 現時為 0.99% |
| 託管人費用* 子基金需向託管人支付託管人費用（託管人將從中撥付中國託管人的費用）。 | 現時為 0.1% |
| 行政管理人及登記處費用 | 最高 1%（最低為每月 2,500 美元） |
| 表現費 | 無 |

* 務請注意，該等費用可在向股東發出一個月通知的情況下增加至允許的上限。有關該等費用及開支、其允許的上限以及子基金可能承擔的其他持續開支的進一步詳情，請參閱章程「費用及開支」一節。

其他費用

閣下可能須於買賣子基金股份時支付其他費用。詳情請參閱章程。

其他資料

管理人將於其網站 <http://etf.harvestglobal.com.hk>（該網站未經證監會審閱）刊發有關子基金的重要消息及資料，其中包括：

- (a) 章程及本概要（經不時修訂）；
- (b) 最新的年度及半年度財務報告（僅提供英文版）；
- (c) 有關章程或子基金組成文件之重大修改或補充的任何通告；
- (d) 任何由子基金發出的公告，包括關於子基金的資料、暫停計算資產淨值、收費調整以及暫停及恢復買賣的通知；
- (e) 以港元計算接近實時的指示性每股資產淨值（每個交易日全日每15秒更新一次）；

- (f) 子資金的最新資產淨值及最新每股資產淨值（以港元計算）；
- (g) 每月更新的完整投資組合資料（於每月月底後一個月內更新）；及
- (h) 參與證券商及莊家的最新名單。

重要提示

閣下如有疑問，應尋求專業意見。

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發表任何聲明。

公司已於證監會註冊為開放式基金型公司。公司及子基金已獲證監會認可為集體投資計劃。證監會的註冊及認可不等如對公司或子基金作出推介或認許，亦不是對公司、子基金的商業利弊或其表現作出保證，更不代表公司或子基金適合所有投資者，或認許其適合任何個別投資者或任何類別的投資者。