

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如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 ETF 系列（「信託」）

GLOBAL X 恒生 ESG ETF

（港元櫃台股份代號：3029）
（「子基金」）

（此為 Global X ETF 系列的子基金，而該系列為根據香港《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）¹

公告

恒指 ESG 增強指數變更

尊敬的單位持有人：

未來資產環球投資（香港）有限公司，作為信託和子基金的管理人（「管理人」），謹此通知，恒生指數有限公司已對恒生 ESG 增強指數（「相關指數」），即子基金的相關指數，進行了以下指數方法的變更：

1. 相關指數變更

相關指數的方法將通過調整加權方法來反映相關指數的行業權重（「變更」）進行增強。根據更新的方法，相關指數的變更將於 2025 年 6 月 9 日生效

子基金的招股說明書將更新以反映該等變更。請參閱下表了解招股說明書在變更前後的受影響部分：

相關指數方法變更前	相關指數方法變更後
-----------	-----------

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。

在招股說明書附錄 5 —GLOBAL X 恒生 ESG ETF 中，標題為「指數說明」部分下的子部分標題「加權方法」	相關指數的編制基於經修改的自由流通市值加權公式，並對個股權重設定以下上限。
基礎指數的編制基於經修改的自由流通市值加權公式，並對個股權重設定以下上限。 在應用上述三項篩選後，基礎指數中剩餘的證券將根據 ESG 風險評級進行傾斜調整。ESG 風險評級相對較高（較低）的證券的權重將會調低（調高），但外國公司成份股的個股權重上限為 4%，其他成份股的個股權重上限則為 8%。外國公司成份股的總權重上限進一步設定為 10%（與基礎指數的成份股權重上限相同）。 ESG 風險評級在基礎指數成份股中標準化後，得出 Z 值。Z 值與 ESG 風險評級反向，ESG 風險評級較低的成份股會得到較高的 Z 值。權重調整因子的計算方式為：Z 值越高，權重調整因子越大，但須受限於與基礎指數相同的權重上限。因此，ESG 風險評級相對較高（較低）的證券的權重將會調低（調高）。 指數水平、Z 值和權重調整因子的計算公式如下所示： <u>指數水平</u> $I_t = I_{t-1} \times \frac{\sum (P_t \times IS \times FAF \times CF \times TF)}{\sum (P_{t-1} \times IS \times FAF \times CF \times TF)}$ 其中 I_t = t日當前指數水平 I_{t-1} = (t-1)日收市指數水平 P_t = t日當前價格 P_{t-1} = (t-1)日收市價格 IS = 已發行股份 FAF = 自由流通調整因子²（介乎0至1） CF = 基礎指數上限因子³（介乎0至1） TF = 調整因子 <u>Z 值</u> $z = \max\left(\min\left(-1 \times \frac{ESG\text{風險評級} - \mu}{\sigma}, 3\right), -3\right)$ 其中 z = Z 值 μ = 成份股的 ESG 風險評級平均值	相關指數的編制基於經修改的自由流通市值加權公式，並對個股權重設定以下上限。 在應用上述三項篩選後，基礎指數中剩餘的證券將根據 ESG 風險評級進行權重調整。ESG 風險評級相對較高（較低）的證券的權重將會調低（調高），並且傾斜強度增加。傾斜後的權重將進一步調整，使相關指數的行業權重反映基礎指數的行業權重。隨後，相關指數的成份股權重將受限於行業調整權重，使傾斜後的權重等於行業目標權重，並且權重上限需遵守兩項限制，即基礎指數中的個股權重上限和最大容量比率。對於個股權重，外國公司成份股的個股權重上限為 4%，其他成份股的個股權重上限則為 8%。外國公司成份股的總權重上限進一步設定為 10%（與基礎指數的成份股權重上限相同）。 ESG 風險評級在相關指數成份股中標準化後，得出 Z 值。Z 值與 ESG 風險評級反向，ESG 風險評級較低的成份股會得到較高的 Z 值。權重調整因子的計算方式為使用傾斜強度乘數 5，使得較高的 Z 值會有較大的權重調整因子，但須受限於行業權重調整以及基礎指數中的成份股權重上限和最大容量比率。因此，ESG 風險評級相對較高（較低）的證券的權重將會調低（調高）。 Z 值、權重調整因子、成份股權重上限、行業權重上限、行業目標權重和成份股目標權重在季度重新平衡時的計算公式如下所示： <u>Z 值</u> $z_i = \max\left(\min\left(-1 \times \frac{E_i - \mu}{\sigma}, 3\right), -3\right)$ 其中 z_i = 第i個成份股的Z值 E_i = 第i個成份股的ESG風險評級 μ = 成份股的ESG風險評級平均值 σ = 成份股的 ESG 風險評級標準差 <u>調整因子</u>

² 自由流通調整因子旨在從指數水平的計算中剔除「非流通」股份。該等股份可能為長期戰略目的而持有，因此並非隨時可在市場上交易。

³ 任何比重高於上限水平的成份股將獲分配一個小於 1 的上限因子，以調整股份數量，從而調低比重。

σ = 成份股的 ESG 風險評級標準差

調整因子

$$\text{調整因子} = \begin{cases} \min(1 + \frac{z \times m}{s}, \frac{\text{cap}}{w_b}) & z \geq 0 \\ \frac{1}{1 + |z| \times m \times s} & z < 0 \end{cases}$$

其中

w_b = 基礎指數的成份股比重

cap = 根據基礎指數的權重上限限制，成份股比重上限

m = 控制調整幅度的調整強度乘數（設為2）

s = 歸一化比例因子，這是一個解出的單值，使成份股比重之和為1。

$$tf_i = \begin{cases} \min(1 + z_i \times m) & z \geq 0 \\ \frac{1}{1 + |z_i| \times m} & z < 0 \end{cases}$$

其中

tf_i = 第*i*個成份股的調整因子

m = 控制調整幅度的調整強度乘數（設為5）

成份股權重上限

$$cwc_i = \min(cwc_i^B, w_i^B \times CR)$$

其中

cwc_i = 指數中第*i*個成份股的權重上限

cwc_i^B = 基礎指數中第*i*個成份股的權重上限

w_i^B = 基礎指數中第*i*個成份股的權重

CR = 容量比率，設為10

行業權重上限

$$iwc_J = \sum_{i \in J} cwc_i$$

其中

iwc_J = 基礎指數中行業*J*的權重上限

行業目標權重

行業目標權重 (itw_j) 根據以下步驟確定：

1. 將行業目標權重設為基礎指數中該行業的權重。
2. 將行業目標權重限制在行業權重上限內。超出部分將分配給其他未受限的行業目標權重。此過程重複進行，直到所有行業的目標權重都限制在各自的行業權重上限內。

成份股權重

1. 成份股權重計算如下：通過將權重調整因子與基礎指數中的成份股權重相乘，得到調整權重(w_i^T)

$$w_i^T = tf_i \times w_i^B$$

其中

w_i^T = 第*i*個成份股的調整權重

	2. 應用行業權重調整，形成行業調整權重 ($\hat{W}_i^T$)，使指數中的每個行業的權重等於行業目標權重： $\hat{W}_i^T = w_i^T \times \frac{itw_J}{iw_J} \quad \text{for } i \in J$ 其中 $\hat{W}_i^T$ = 第 i 個成份股的行業調整權重 itw_J = 行業 J 的目標權重 iw_J = 行業 J 中成份股的調整權重總和 3. 為了得到最終的成份股權重，行業調整權重須受限於成份股權重上限。超出部分將分配給同一行業中其他未受限的成份股。
--	--

2. 對子基金的影響

除上述內容外，實施這些變更後，管理該子基金的費用或成本不會發生變化。

除上述另有規定外，管理子基金的營運及 / 或管理子基金的方式將不會出現任何變動，上述變更不會影響子基金的現有投資者。而子基金的特性或風險狀況亦不會出現任何變動。投資者的權利或利益亦將不會因本公告所載的變動而受到重大損害。

本公告所述的變動無須投資者批准。

3. 一般事項

投資者如對本公告有任何有關疑問，可於辦公時間至香港銅鑼灣新寧道 1 號利園 3 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
作為本信託及子基金的管理人
日期：2025 年 5 月 9 日