

2026 年 9 月

發行人：華泰盈科資產管理有限公司

- 此為被動式交易所買賣基金。
- 本概要旨在為閣下提供有關本產品的主要資料。
- 本概要是章程的一部分。
- 閣下不應單憑本概要投資於本產品。

資料便覽

股份代號：	03569
每手買賣單位數目：	100 股股份
基金經理：	華泰盈科資產管理有限公司
託管人：	滙豐機構信託服務（亞洲）有限公司
全年經常性開支*：	1.8%
估計每年追蹤偏離度#	-2%
指數：	香港交易所韓國交易所半導體指數（淨總回報）
基礎貨幣：	港幣
交易貨幣：	港幣
分派政策：	每年（通常為每年十二月），由基金經理酌情決定。 基金經理可酌情決定子基金是否分派任何股息、分派頻率及股息金額。概不保證定期分派，亦不保證分派（如作出）的金額。股息可從相關類別的資本或實際從資本中支付，並可能導致子基金的每股資產淨值（「 資產淨值 」）即時減少。
財政年度終結日：	12 月 31 日
網址：	www.huatai-pb.com.hk（本網站未經證監會審閱）

* 由於子基金為新成立，此僅為估計數字。其指於 12 個月期間子基金應付的估計經常性開支，以佔同期子基金估計平均資產淨值的百分比列示。該數字可能每年有所不同。實際數字可能與估計數字不同。經常性開支數字不包括本文所討論的掉期費用。

由於子基金為新成立，此為估計每年追蹤偏離度。有關更多實際追蹤偏離度的最新資料，投資者應閱覽子基金的網站。

本基金是甚麼產品？

華泰盈科香港交易所韓國交易所半導體指數 ETF（「**子基金**」）為華泰盈科公募開放式基金型公司（「**公司**」）的子基金，該公司是根據香港法例成立的公眾傘子開放式基金型公司，具有可變動股本、有限責任及子基金之間的分隔責任，並根據證券及期貨條例（第 571 章）第 IVA 部註冊及成立。子基金為一隻被動式管理指數交易所買賣基金，受《單位信託及互惠基金守則》（「**守則**」）第 8.6 章規管。

子基金的股份在香港聯合交易所有限公司（「**聯交所**」）上市，並如上市股票般在聯交所買賣。

目標及投資策略

投資目標

子基金的投資目標為提供在扣除費用及開支前，與香港交易所韓國交易所半導體指數（淨總回報版本）（「**指數**」）表現緊密對應的投資回報。概不保證子基金將實現其投資目標。

投資策略

全面複製策略

為達致子基金的投資目標，基金經理主要採納全面複製策略，將子基金的全部或絕大部分資產，按指數證券在指數中的權重（即比例）大致相同的比例直接投資於構成指數的證券（「**指數證券**」）。

倘基金經理全權酌情認為適當，亦可採納實物代表性抽樣及合成代表性抽樣策略的組合。子基金將(i)透過將其資產淨值的50%至100%投資於指數證券以採用實物代表性抽樣策略；及(ii)倘基金經理認為該等投資對子基金有利並將有助於基金達致其投資目標，則透過將其最多50%的資產淨值投資於金融衍生工具（「**金融衍生工具**」）（僅為與一名或多名交易對手方訂立的預付款總回報掉期）以採用合成代表性抽樣策略作為輔助策略。子基金可全權酌情隨時在其認為適當之情況下，在全面複製策略與代表性抽樣策略之間切換，以便盡可能貼近追蹤該指數，而毋須事先通知投資者。

實物代表性抽樣策略

子基金透過將其資產淨值的50%至100%投資於指數證券以採用實物代表性抽樣策略。子基金可將其最多100%的資產淨值直接投資於在聯交所及韓國交易所股份有限公司（「**韓國交易所**」）上市的股本證券。

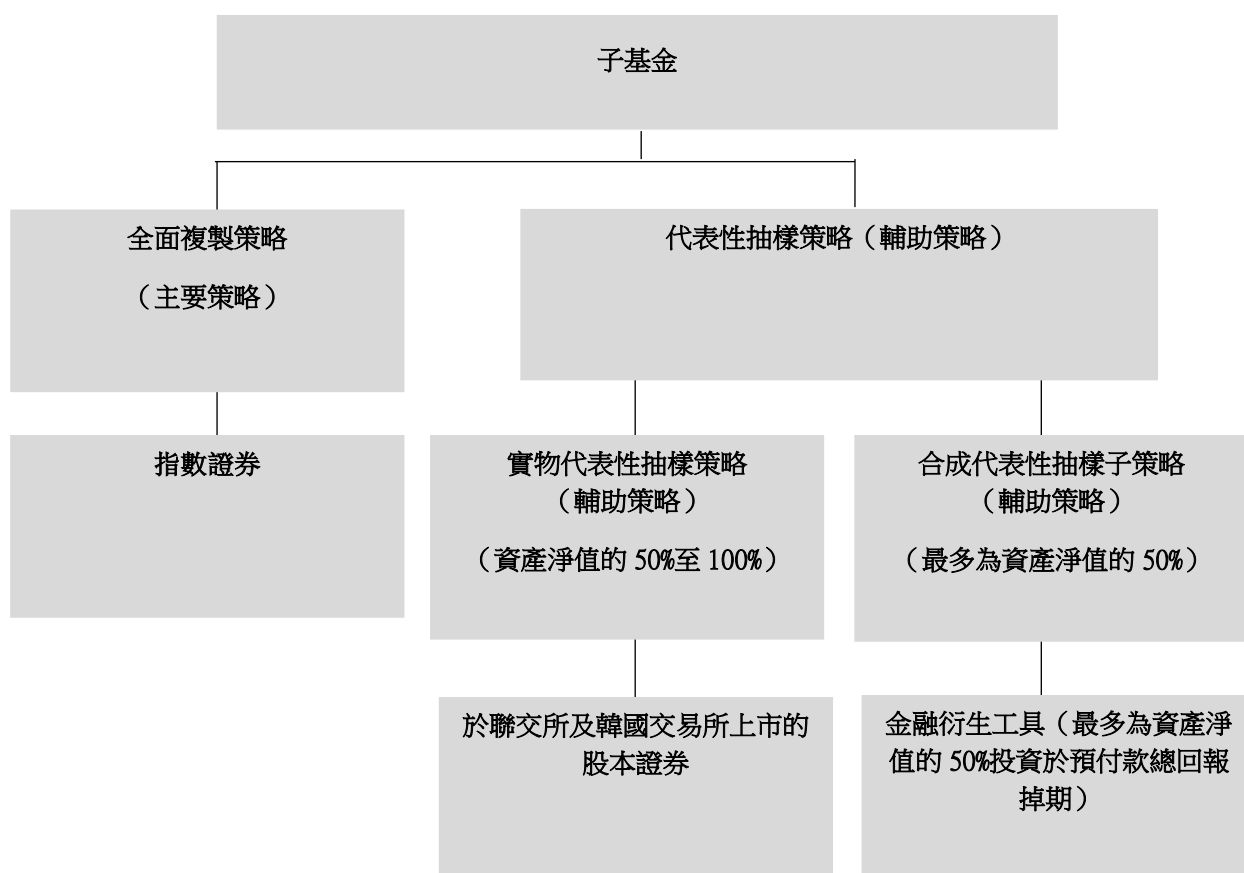
合成代表性抽樣策略

子基金的合成代表性抽樣策略將涉及將其最多50%的資產淨值投資於金融衍生工具，其中僅為直接投資於由總回報掉期交易提供資金的金融衍生工具。僅當基金經理認為有關投資對子基金有利時，方會採用合成代表性抽樣策略。

就預付款總回報掉期交易的投資而言，子基金將向掉期交易對手方轉交相關部分現金，而掉期交易對手方將反過來為子基金提供對指數證券表現的經濟收益／虧損（扣除交易成本）的風險承擔。子基金須承擔掉期費用（包括經紀佣金及任何與訂立、平倉或維持有關該等掉期的任何對沖安排相關的成本），因此可能對子基金的資產淨值產生不利影響，並導致較高的追蹤誤差。掉期費用（包括與掉期交易相關的所有成本，並須由基金經理與掉期交易對手方根據實際市場情況按個別情況討論並達成共識）指可變差價（可為正數或負數）另加香港銀行同業拆息或有擔保融資利率參考利率，其反映為提供表現而對相關對沖進行融資的經紀佣金及掉期交易對手方的成本。掉期費用每日累計並於該月攤分。在極端市況及特殊情況下，經紀佣金及與對沖安排相關的成本可能大幅增加，並因而增加掉期費用。子基金就每宗交易應付的最高平倉費為所平倉掉期名義金額的0.5%。掉期費用將於子基金的中期及年度財務報告中披露。

子基金於指數證券（透過直接投資或金融衍生工具）的風險承擔，其權重（即比例）將與該等指數證券在指數中的權重大致相同。基金經理可導致子基金偏離指數比重，惟任何成份股偏離指數比重的最大幅度不得超過3%或基金經理諮詢證監會後釐定的其他百分比。

下圖顯示子基金的投資策略：



證券借出交易

基金經理可代表子基金訂立證券借出交易，最高水平可達子基金資產淨值的50%，預期水平約為子基金資產淨值的20%。子基金可隨時收回借出的證券。作為證券借出交易的一部分，子基金必須收取現金及／或非現金抵押品，其價值須每日按市價計值，且至少為借出證券價值（包括利息、股息及其他最終權利）的100%。抵押品將以符合子基金最佳利益的方式作出並由託管人或由託管人委任的代理人保管。所收取的非現金抵押品不可出售、再作投資或質押。收到的任何現金抵押品的再投資須遵守守則所載的規定。

目前，子基金將不會訂立銷售及回購交易、反向回購交易或其他類似的場外交易。基金經理在從事任何上述投資前，將尋求證監會的事先批准（如有需要），並至少提前一個月通知股東。

其他投資

子基金亦可為現金管理目的，投資不多於其資產淨值的10%於現金及現金等價物，包括根據守則第8.2章獲認可或屬守則第7.11A章下的合資格計劃的貨幣市場基金。子基金資產淨值中不多於30%可投資於集體投資計劃（「**集體投資計劃**」），該等計劃須與相關指數有高度相關性，並根據《守則》的所有適用規定獲證監會認可。為免生疑問，本段開頭所述

子基金於貨幣市場基金的投資不受此項限制。於交易所買賣基金的任何投資將被視為集體投資計劃，並因此須遵守《守則》第7.11A及7.11B章的規定。

指數

該指數旨在衡量於香港上市且符合港股通資格之半導體相關公司，連同韓國交易所半導體15指數所有成份證券之表現。該指數作為結合相關市場互聯互通機制之跨市場基準，其設計旨在符合ETF通之規定。該指數為一隻有30隻成份股的經自由流通量調整市值加權指數。

就香港上市部分而言，成份股乃從市值最高的15隻半導體相關證券（即Revere Business Industry Classification System（「RBICS」）項下「半導體製造」及「半導體設備及服務」分部旗下的公司）將被選為指數成份股。

倘可供選擇的半導體相關證券少於15隻，則市值最高的額外證券（即RBICS項下「電子元件」、「通訊設備」及「電腦硬體與儲存」分部旗下的公司）（「**補充成份股**」）將被加入，直至成份股數目達到15隻為止。

就韓國上市部分而言，其包括作為韓國交易所半導體15大指數成份股的所有15隻證券。韓國交易所半導體15大指數包括在KOSPI或科斯達克市場上市，並根據全球產業分類標準分類於半導體及半導體設備（4530）版塊的證券。

該指數按兩個部分的加權組合計算：(i)香港上市成份股，權重為62%；及(ii)韓國上市成份股，權重為38%。

該指數於六月及十二月第二個星期五收市後每半年檢討一次。指數權重上限調整及重新平衡於三月、六月、九月及十二月每季度在該月第二個星期五收市後進行。於每次重新平衡時，（i）各隻香港上市半導體相關成份股及各隻韓國上市成份股之權重上限為12%；及（ii）各隻香港上市補充成份股之權重上限為3%。

該指數為淨總回報指數，即指數成份股的表現乃按任何股息或分派於扣除預扣稅（如有）後再作投資的基準計算。指數以港幣計值及報價。該指數於2026年3月31日推出。該指數的基日為2020年12月31日，截至基日的基值為10,000點。

於2026年6月15日，該指數的總市值為21.97萬億港元。

該指數為一隻聯名指數，由香港交易所及韓國交易所（「**指數供應商**」）共同開發。Solactive AG為該指數的計算代理（「**指數計算代理**」）。基金經理及其關連人士獨立於指數供應商及計算代理。

該指數的最後收市水平及額外資料（包括重要消息、指數編製方法以及成份股名單及其各自的權重）可於基準管理人網站 https://www.hkex.com.hk/Services/Market-Data-Services/Index-Services/KRX-Semiconductor?sc_lang=en#&product=HKEXKRXS 或基金經理網站 www.huatai-pb.com.hk 查閱。

供應商代碼

彭博社：HKEXKRXN

Refinitiv 識別碼：HKEXKRXN

** 投資者務請注意，上述網站及其內容未經證監會審閱。*

使用衍生工具 / 投資衍生工具

子基金的衍生工具淨風險承擔最高為子基金資產淨值的 50%。

本基金有哪些主要風險？

投資涉及風險。請參閱章程，了解風險因素等詳情。

1. 一般投資風險

- 子基金的投資組合可能因下列任何主要風險因素而價值下跌，因此閣下於子基金的投資可能會蒙受損失。概不保證可取回本金。概不保證子基金將實現其投資目標。

2. 股票市場風險

- 子基金於股本證券的投資須承受一般市場風險，其價值可能受多個因素影響而波動，例如投資情緒變化、政治及經濟狀況及發行人特定因素等。

3. 新指數風險

- 該指數為一項新指數，於2026年3月31日推出，其營運歷史有限，投資者難以據此評估其過往表現。無法保證指數的表現。與其他追蹤有較長運作歷史且更為成熟的指數的交易所買賣基金相比，子基金或須承受較高風險。

4. 半導體行業風險

- 子基金投資於半導體及半導體相關行業的公司，該等公司或會尤其受到該等行業激烈競爭的影響。可能導致半導體版塊及相關行業內證券價值惡化的具體因素包括但不限於：國內外競爭壓力、因行業快速發展而導致的產品迅速淘汰、客戶的經濟表現、龐大的資本支出、迅速淘汰以及原材料或設備的潛在短缺。半導體及相關行業的公司通常在研發方面作出重大開支，且無法保證該等公司生產的產品將能轉化為商業上成功的產品。

- 半導體及半導體相關行業可能面臨政府干預、制裁及貿易保護主義。半導體及相關行業的公司通常依賴於維持與其技術合作夥伴的關係。倘該等關係受損或終止，公司可能無法及時或按商業上有利的條款訂立新的技術聯盟。半導體及相關行業亦具有週期性市場模式與定期產能過剩的特性。凡此種種均可能損害半導體及相關公司的業務與營運業績。

5. 韓國市場風險

- 投資者應注意與韓國市場交易相關的潛在市場風險，特別是市場波動調節機制及每日價格限制的影響。韓國證券交易所設有市場波動調節機制或每日漲跌停板規則等機制，該等機制有可能導致市場停市，從而暫停當日的交易活動。該等中斷會影響子基金的正常重新平衡過程，從而影響其達到目標風險承擔水平的能力。因此，這可能導致追蹤偏離度增加。在因該等機制而導致交易暫停的極端情況下，指數的回報可能會在下一個正常交易日累積並反映在產品中。該等情況可能導致重大損失。

6. 集中風險

- 由於指數成份股集中於香港及韓國以及半導體及相關行業，子基金的投資可能同樣集中。子基金的價值可能較擁有更多元化投資組合的基金更具波動性。子基金的價值更容易受到影響香港及韓國市場以及半導體及相關行業的不利經濟、政治、政策、外匯、流動性、稅務、法律或監管事件的影響。

7. 與中國內地風險承擔有關的風險

- 子基金可大舉投資於對中國內地有經濟風險敞口的香港上市公司。投資於該等公司可能涉及一般與投資於較發達市場無關的更高風險及特殊考慮，例如流動性風險、貨幣風險／管制、政治、政策及經濟不確定性、法律、監管及稅務風險、結算風險、託管風險及高度波動的可能性，而子基金的價值可能更容易受到影響中國內地的該等相關不利事件的影響。

8. 與中小型市值公司相關的風險

- 一般而言，與市值較大的公司相比，中小型市值公司的股票流動性較低，且其價格較易因不利經濟形勢而波動。

9. 金融衍生工具風險

- 子基金將其最多 50%的資產淨值投資於金融衍生工具，該等工具將為透過一個或多個掉期交易對手方訂立的預付款總回報掉期。因此，倘掉期交易對手方未能履行其義務，或在掉期交易對手方無力償債或違約的情況下，子基金可能會蒙受重大損失。
- 與金融衍生工具有關的風險包括交易對手方／信貸風險、流動性風險、估值風險、波動性風險及場外交易風險。金融衍生工具易受價格波動及較高波動性的影響，並

可能具有較大的買賣差價且無活躍的二級市場。金融衍生工具的槓桿元素 / 組成部分可能導致損失遠大於子基金投資於該金融衍生工具的金額。投資於金融衍生工具可能導致子基金蒙受重大損失的高風險。

10. 貨幣風險

- 子基金的相關投資可能以其基礎貨幣以外的貨幣計值。子基金的資產淨值可能會因該等貨幣與基礎貨幣之間的匯率波動及匯率管制的變動而受到不利影響。

11. 證券借出交易風險

- 證券借貸交易可能涉及借入人未能及時歸還借出證券的風險，以及抵押品的價值可能跌至低於借出證券的價值。

12. 被動投資風險

- 子基金乃被動式管理，而一般而言，由於子基金的固有投資性質，基金經理將無酌情權適應市場變動。指數下跌預期將導致子基金的價值相應下跌。

13. 追蹤誤差風險

- 子基金或會承受追蹤誤差風險，此為其表現未能準確追蹤指數表現的風險。此追蹤誤差可能由所採用的投資策略以及費用及開支等因素造成。基金經理將監控並力求管理上述風險，盡量減低追蹤誤差。概無保證子基金於任何時候均可精確地或完全相同地複製指數的表現。

14. 交易風險

- 一般而言，零售投資者僅可在聯交所買賣股份。聯交所的股份交易價格受股份供求等市場因素帶動。因此，股份可能以較子基金資產淨值大幅溢價或折讓的價格買賣。由於投資者在聯交所買入或賣出股份時須支付若干費用（例如交易費及經紀費），投資者在聯交所買入股份時所支付的款項或會高於每股資產淨值，而在聯交所賣出股份時所收到的款項或會低於每股資產淨值。

15. 交易時段不同風險

- 由於指數證券上市的證券交易所或於子基金股份未定價時開市，子基金投資組合內的投資價值可能在投資者無法買賣股份的日子或時間變動。指數證券上市的證券交易所與聯交所之間的交易時間差異，亦可能增加股份交易價格對其資產淨值的溢價或折讓水平。

16. 指數相關風險

- 該指數可能無法反映半導體或半導體相關行業的全部機會。指數構建方法亦可能存在錯誤或偏誤，從而對子基金的表現產生負面影響。

17. 依賴指數計算代理之風險

- 指數計算代理計算並維護指數。倘指數計算代理停止擔任指數的指數計算代理，指數供應商可能無法立即找到具備必要專業知識或資源的繼任指數計算代理，且任何新委任的條款或質素可能不對等或相似。指數的運作存在中斷的風險，這可能會對子基金的運作和表現產生不利影響。

18. 依賴做市商之風險

- 儘管基金經理將竭力訂立安排，以使至少有一名做市商為股份維持市場，且至少有一名做市商在根據相關做市商協議終止做市安排前發出不少於3個月的通知，但倘股份並無或僅有一名做市商，股份的市場流動性或會受到不利影響。概不保證任何做市活動均有效。

19. 終止風險

- 於若干情況下，子基金或須提前終止，例如，當指數不再可供用作業績比較基準、指數供應商終止許可協議，或倘子基金的規模跌至組織章程文件及發售文件所載的預定門檻以下。於子基金終止時，投資者可能未能收回其投資並蒙受損失。

20. 以資本或實際以資本支付分派的風險

- 以資本支付或實際以資本支付分派，等於投資者獲得部分原投資額回報或撤回其部分原投資額或可歸屬於該原投資額的資本收益。任何該等分派均可能導致子基金的每股資產淨值即時減少，並將減少未來可用的資本。

子基金過往的業績表現如何？

由於子基金新成立不足一個完整曆年，因此並無足夠數據為投資者提供過往表現的有用指標。

子基金是否提供擔保？

子基金不設擔保。閣下可能無法全數收回投資本金。

有何費用及收費？

在聯交所買賣子基金時產生的收費

閣下在買賣子基金的股份時，可能須支付以下費用。

費用

閣下支付的金額

經紀佣金

市場收費

交易徵費

股份成交價的 0.0027%¹

會計及財務匯報局（「會財局」）交易徵費	股份成交價的 0.00015% ²
聯交所交易徵費	股份成交價的 0.00565% ³
印花稅	無
1 交易徵費為股份成交價的 0.0027%，由買賣雙方支付。 2 會財局交易徵費為股份成交價的 0.00015%，由買賣雙方支付。 3 聯交所交易徵費為股份成交價的 0.00565%，由買賣雙方支付。	
<u>子基金應付的經常性費用</u> 以下開支將從子基金中扣除。該等開支會對閣下構成影響，因為它們會令子基金的資產淨值減少，從而可能影響買賣價格。	
管理費*	年率（現行費率） 子基金資產淨值的每年 0.99%
託管人費及行政管理費*	計入管理費
表現費	無
* 請注意，若干費用可在向股東發出一個月事先通知後，增加至准許的最高金額。有關須支付的費用及收費、其允許的最高費用，以及其他可能由子基金承擔的持續費用的進一步詳情，請參閱章程「費用及開支」一節。	
<u>其他費用</u> 閣下在買賣子基金的股份時，可能須支付其他費用。進一步詳情請參閱章程。	
<u>其他資料</u> 基金經理將以中、英文（除另有指明外）在基金經理網站www.huatai-pb.com.hk*發佈有關子基金的重要新聞及資訊，包括： ● 章程及本產品資料概要（經不時修訂及補充）； ● 子基金的最近期經審核年度財務報告及未經審核半年度財務報告（僅提供英文版）； ● 任何由子基金發出的公告，包括有關子基金及指數的資料、暫停增設及贖回股份的通知、暫停計算資產淨值、費用變更以及暫停及恢復股份買賣； ● 有關對子基金的重大變更而可能對其投資者有影響的任何通知，例如對子基金的發售文件及組織章程文件作出重大修改或增補；	

- 子基金的最後資產淨值（以其基礎貨幣（港幣）計）及每股最後資產淨值（以其交易貨幣（港幣）計）；
- 於各交易日在聯交所交易時段每15秒更新一次、以其交易貨幣（港幣）計值的每股接近實時參考資產淨值；
- 子基金各股份類別的過往表現資料；
- 子基金的年度追蹤偏離度及追蹤誤差；
- 參與證券商及做市商的最新名單；
- 子基金的完整投資組合資料（每日更新）；
- 最近12個月的分派組成（即自(i)可分派淨收入及(ii)資本中派付的相對金額）（如有）。

* 投資者務請注意，上述基金經理網站未經證監會審閱。

重要提示

閣下如有疑問，應諮詢專業意見。

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。證監會的註冊及認可不代表對本公司或子基金作出推介或認許，亦不保證本公司或子基金的商業利弊或其表現。此舉不代表本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投資者。