

重要提示：此乃重要函件，務須閣下即時垂注。閣下如對本函件之內容有任何疑問，應尋求獨立專業意見。以下各基金的經理人施羅德投資管理（香港）有限公司就本函件所載資料之準確性承擔全部責任，並在作出一切合理查詢後確認，盡其所知所信，本函件並無遺漏足以令本函件的任何陳述具誤導成分的其他事實。

除非本文另有指明，否則本函件中所用的特定詞彙與各子基金的解釋說明書（「解釋說明書」）所界定者具相同涵義。

親愛的單位持有人：

施羅德傘型基金 II（「本基金」）

- 施羅德亞洲高息股債基金
- 施羅德中國股債收息基金
- 施羅德中國進取股票基金
- 施羅德中國定息基金
- 施羅德環球主題股債基金

（各稱及統稱「子基金」）

我們茲致函通知閣下，除非本文另有指明，否則子基金於 2023 年 3 月 13 日（「生效日」）起作出以下更改或更新。

A. 有關直接投資於中國內地銀行間債券市場（「中國銀行間債券市場」）的更新

以下各子基金有關直接投資於中國銀行間債券市場的投資目標及／或政策將作出多項更新，概述如下：

(a) 施羅德中國定息基金

目前，子基金的目標是主要（不少於淨資產的 70%）透過施羅德投資管理（香港）有限公司的合格境外投資者（「QFI」）資格，投資於在中國內地發行或銷售的債務證券和定息工具（「境內中國定息證券」），為投資者提供一個持續和長期的資本增值和收益（以人民幣

（「人民幣」）計算）。透過根據債券通（誠如解釋說明書中標題為「中國銀行間債券市場概況」一節中進一步描述）及／或有關規例可能不時允許的其他方式投資於中國內地銀行間債券市場（「中國銀行間債券市場」）亦可獲得對境內中國定息證券的直接投資。

由生效日起，子基金的投資目標將作出簡化，以規定子基金的目標為提供一個持續和長期的資本增值和收益（以人民幣計算）。為免生疑問，子基金的投資目標並無變更。子基金的投資政策將作出修訂，以規定子基金亦可透過根據境外投資機制（將於經修訂解釋說明書中標題為「中國銀行間債券市場概況」一節中進一步描述）投資於中國銀行間債券市場，以投資於境內中國定息證券。境外投資機制將作為子基金根據其現有投資目標和政策投資於中國銀行間債券市場的另一方式。

(b) 施羅德亞洲高息股債基金

目前，子基金可透過根據債券通及／或有關規例可能不時允許的其他方式投資於中國銀行間債券市場，以直接投資於境內中國定息證券。

由生效日起，子基金的投資政策將作出修訂，以規定子基金亦可透過根據境外投資機制投資於中國銀行間債券市場，以投資於境內中國定息證券。境外投資機制將作為子基金根據其現有投資目標和政策投資於中國銀行間債券市場的另一方式。

為免生疑問，子基金於中國 A 股、中國 B 股及境內中國定息證券的直接和間接總投資並無變更，其將不會超過其資產淨值的 20%。

(c) 施羅德環球主題股債基金

由生效日起，子基金的投資政策將作出改善，以規定子基金透過根據境外投資機制及／或債券通及／或有關規例可能不時允許的其他方式投資於中國銀行間債券市場，以直接投資於境內中國定息證券。

為免生疑問，子基金於中國 A 股、中國 B 股及境內中國定息證券的總投資並無變更，其將會少於其資產淨值的 30%。

有關 QFI 制度、中國銀行間債券市場、境外投資機制或債券通的進一步詳情，請參閱子基金的經修訂解釋說明書。

子基金透過境外投資機制及／或債券通投資於中國銀行間債券市場，將須承受解釋說明書及子基

金產品資料概要目前披露的風險，包括但不限於有關投資於債務證券的風險、投資於中國內地市場的相關風險／中國內地市場風險，以及有關中國銀行間債券市場的風險。

B. 有關間接投資於中國 A 股的更新

由生效日起，施羅德亞洲高息股債基金的投資政策將作出更新，以簡化有關其對中國 A 股的間接投資的披露。經更新的投資政策將規定子基金可透過投資於（包括但不限於）可進入中國市場的產品、投資基金及 ETF 以尋求間接投資於中國 A 股。儘管子基金將不再限制其於可進入中國市場的產品及／或與中國 A 股表現掛鈎的衍生工具的各發行人的總風險承擔為不超過其資產淨值的 10%，子基金將繼續遵守解釋說明書附表一中所載的投資限制及多元化規定。

C. 有關投資於保險相連證券（「ILS」）及 ILS 相關產品的更新

由生效日起，施羅德亞洲高息股債基金、施羅德中國股債收息基金、施羅德中國定息基金及施羅德環球主題股債基金的投資政策將作出更新，以規定各子基金可將其最多 10% 的資產淨值投資於在香港以外地區發行的 ILS（例如災難債券）及／或任何 ILS 相關產品（例如其收益與任何 ILS 表現掛鈎的衍生工具或結構性產品及其投資目標或主要投資策略是投資於 ILS 的集體投資計劃）。為免生疑問，子基金不會投資於在香港發行的 ILS 及其重新包裝的產品及衍生工具。

由於子基金投資於 ILS 及 ILS 相關產品，子基金可能面臨以下風險：

保險相連證券／災難債券風險

保險事件如天然、人為或其他災難可對保險相連證券造成嚴重或完全損失。

子基金可投資於一旦發生觸發事件（即自然災害或金融或經濟失誤）則可能會損失部份或全部價值的災難債券。

災難可由各種事件造成，包括但不限於颶風、地震、颱風、雹暴、水浸、海嘯、龍捲風、暴風、極端氣溫、空難、火災、爆炸和海難。該等災難的發生和嚴重性本身難以預計，子基金因該等災難蒙受的損失可以十分嚴重。任何氣候或其他事件可能增加該等事件發生的可能性及／或嚴重性（如全球暖化導致颶風更頻密和更猛烈），其將對子基金於該等證券的持股造成重大不利影響。

縱使子基金於該等事件的風險將根據其投資目標而被限制及分散，然而某單一災難事件可以影響多個地區和行業，或者災難事件發生的頻密度或嚴重性可以超出預期，以上任何一種事件皆可對子基金於該等證券的持股造成重大不利影響。

損失金額以災難債券層面界定，可能以公司或行業的損失、名義投資組合的模擬損失、行業指數、科學工具的讀數或與災難相關的若干其他參數為基礎，而非實際損失。用於計算觸發事件概率的模型可能不準確或可能低估觸發事件發生的可能性，這可能會增加損失風險。

災難債券或會延長到期期限，這可能會增加波動性，且信用評級機構可能會根據觸發事件將予發生的可能性而對其進行評級。災難債券的信貸評級通常低於投資級別（如未獲評級，則被視為同等信貸評級）。

D. 有關貨幣兌換的更新

解釋說明書中有關就認購、贖回或轉換單位而向相關子基金付款或從相關子基金中收取款項的貨幣兌換披露將作出更新及簡化。為免生疑問，貨幣兌換的風險及成本及其他相關收費及開支將由相關投資者承擔。

E. 有關支付贖回款項及/或人民幣計值類別的分派的更新

解釋說明書有關在極端市況下支付贖回款項及/或人民幣計值類別的分派之披露將予更新。當用作貨幣兌換的人民幣不足夠時，經理人可在獲得受託人批准後以經理人認為適當的其他貨幣支付贖回款項及/或分派。

F. 對單位持有人的影響

除上文所述者外，子基金的所有其他主要特點，包括費用水平、收費結構及子基金的實際管理方式維持不變。上述更新不會構成子基金的任何重大變更。作出更新後子基金的整體風險概況將不會出現重大變更或加劇，且更新不會對單位持有人的權利或權益造成任何重大不利影響。

G. 對發售文件的修訂

為反映上述相關更新及其他雜項或一般更新，解釋說明書及子基金的產品資料概要將會作出修訂。子基金的最新發售文件可在網站（www.schroders.com.hk）¹查閱或向本公司的辦事處（香港金鐘道 88 號太古廣場二座 33 字樓）免費索取。

¹ 此網站未經證監會審閱。

H. 查詢

閣下如需要更多資料，請聯絡閣下常用的專業顧問或致電施羅德投資熱線電話：(+852) 2869 6968 查詢。

施羅德投資管理（香港）有限公司

2023年3月13日