

此乃重要函件，務請閣下垂閱。閣下如對本函件的內容有任何疑問，應尋找獨立專業的意見。施羅德環球基金系列的管理公司 **Schroder Investment Management (Europe) S.A.** 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。

親愛的股東：

施羅德環球基金系列

我們茲致函通知閣下，以下對本公司及其子基金（「基金」）的香港發售文件（包括本公司的發行章程和香港說明文件及基金的產品資料概要（「香港發售文件」））作出的更改或更新。

本函件中未有界定的任何用詞與發行章程的用詞具有相同涵義。

I. 更改環球氣候變化策略的可持續基準

環球氣候變化策略的可持續基準已由「MSCI World (Net TR) index」更改為「MSCI All Country World (Net TR) index」，以與比較基準符合一致，基金從而可根據投資經理的評級系統，將總體減排量水平維持高於 MSCI All Country World (Net TR) index。

II. 更改亞洲債券的投資政策

亞洲債券的投資政策已作出更新，以規定基金對總回報掉期的總投資將不超過基金資產淨值的 20%（過往為 60%），以及預期範圍已由基金資產淨值的「0-30%」縮減至「0%-5%」。同時亦已作出澄清，規定目標是在包括但不限於經濟增長放緩及利率下跌期間，以及投資經理認為主權利差溢價將壓縮的情況等市況下暫時利用總回報掉期。為免生疑問，基金的現有慣例（包括衍生工具風險承擔淨額）並無變更。

III. 基金的投資政策的加強披露／澄清

若干基金的投資政策已作出加強披露或澄清。有關修訂的詳情，請參閱附錄。

IV. 雜項更新／更改

香港發售文件亦已作出額外更改，包括以下各項：

- (a) 加強有關(i)擁有環境及／或社會特色（具 SFDR 第 8 條的涵義）或擁有可持續投資目標（具 SFDR 第 9 條的涵義）的每隻基金的該等特色或目標資料的 SFDR 合約前披露；(ii)對 SFDR 項下的主要不利影響的考慮及(iii)分類規例的披露；
- (b) 加強披露，以規定當基金表示至少將其資產某特定百分比投資於(i)根據 SFDR 界定的可持續投資；或(ii)實現基金推廣的環境或社會特色，該百分比在特殊情況下可能會被暫時違反，例如當投資經理認為符合基金及其股東的最佳利益，可以將基金之投資調整，以應付不利的市況及／或經濟狀況及／或預期波動；
- (c) 澄清交易安排／認購、贖回、暫停及順延的程序，以反映現有慣例；
- (d) 加強有關股東大會程序的披露；
- (e) 澄清處理清盤收益的安排，即在盧森堡法律規定期限（三十年）內尚未領取的保管款項將成為盧森堡大公國的財產；
- (f) 澄清估值基礎是工具可信的市場價值，或如未能提供該價值，則是使用具足夠認可方法決定的定價模式；
- (g) 加強披露，以澄清投資管理費（稱為年度管理費）乃參照基金的資產淨值或每股資產淨值（取適用者）於每個交易日累算並按月繳付；
- (h) 加強投資限制的披露，以規定在正常市況下，各基金不會為輔助性流動目的將其超過 20% 的淨資產投資於現金及即期存款（例如往來賬戶中持有的現金）。在特殊且不利的市況下（例如九一一襲擊事件或 2008 年雷曼兄弟的破產事件），如出於投資者利益理由，此限制可暫時被違反。為澄清起見，香港發售文件已作出加強披露，以規定在特殊情況下（例如：股災或重大危機），基金可暫時將其各自最多 100% 的資產淨值投資於諸如銀行存款、存款證、商業票據及國庫券等流動資產作現金流管理；
- (i) 澄清若基金的投資政策之目的是複製若干獲 CSSF 認可的股票或債券指數的組成成份，有關投資於同一組織發行的股票及／或債券的相關限額之投資限制；
- (j) 澄清可持續評分的披露並加強投資經理專屬可持續工具的披露；

- (k) 澄清投資限額，以規定基金將不會於中國銀行間債券市場（「中國銀行間債券市場」）（包括透過債券通）或任何其他中國受監管市場上交易的可轉讓證券或透過滬港通及深港通於中國 A 股及於上海證券交易所科創板（「科創板」）及深圳證券交易所創業板（「創業板」）上市的股份持有超過 5% 資產，除非在其「投資目標」及「投資政策」有所披露；
- (l) 更新投資排除披露，並規定有關可持續投資限制及於香港獲認可為 ESG 基金的基金排除名單的進一步資料可透過網站 <https://www.schroders.com/en/lu/private-investor/gfc>¹ 閱覽；
- (m) 加強風險披露（例如：信貸風險）及新增風險因素（例如：中小企業板、科創板及／或創業板市場的相關風險）；
- (n) 更新管理公司的董事簡介；及
- (o) 其他澄清、雜項更新、更改及編輯修訂。

除上文所披露外，本公司確認，就上文所載的修訂或更改而言：

- 基金的管理方式並無變更；
- 基金的投資風格、投資理念及風險概況維持不變；及
- 如香港發售文件所述就基金收取的費用維持不變。

經修訂的香港發售文件可於 www.schroders.com.hk² 免費查閱或向本公司香港代表人施羅德投資管理（香港）有限公司索取。

閣下如有任何疑問或需要更多資料，請聯絡閣下常用的專業顧問或香港代表人（地址為香港金鐘道 88 號太古廣場二座 33 字樓）或致電施羅德投資熱線電話(+852) 2869 6968 查詢。

董事會

謹啟

2023 年 4 月 26 日

¹ 此網站未經證監會審閱。

² 此網站未經證監會審閱。

附錄

1. 亞洲債券、新興市場債券、新興市場股債、港元債券和環球股債增長收息 – 澄清投資政策

各基金的投資政策已作出澄清，以規定基金除通過債券通外，亦可通過中國銀行間債券市場直接投資模式投資中國銀行間債券市場投資於中國內地。為免生疑問，各基金對現有中國境內的投資參與並無變更。

2. 亞洲債券、亞幣債券、新興市場債券、新興市場股債、歐元債券、歐元企業債券、歐元流動、環球債券、環球企業債券、環球收息債券、環球高收益、環球通貨膨脹連繫債券、環球股債收息、環球目標回報、港元債券、環球股債增長收息、策略債券、可持續發展股債收息、美元債券和美元流動 – 加強有關保險相連證券（「ILS」）及／或任何 ILS 相關產品的投資政策的披露

各基金的投資政策已作出加強披露，以規定各基金可將其各自的資產淨值最多10%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，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。

3. 歐元債券、環球企業債券、環球收息債券、環球高收益和美元債券 – 更新相關基準的名稱

各基金的目標基準（除就環球收息債券而言為比較基準外）已作出更新，以在基準的名稱中從「Bloomberg Barclays」移除「Barclays」，以反映基準提供商的品牌重塑。為免生疑問，各基金的實際基準並無變更。

4. 歐元企業債券 – 更新目標基準的名稱

基金的目標基準名稱已由「ICE Bank of America Merrill Lynch Euro Corporate index」更新為「ICE BofA Merrill Lynch Euro Corporate index」。為免生疑問，基金的實際目標基準並無變更。

5. 環球股債收息、環球股債增長收息和可持續發展股債收息 – 澄清投資政策

各基金的投資政策已透過從有關基金通過衍生工具投資的披露中移除「將最少三分之二的資產」而作出澄清，因為有關披露對於多元化資產基金而言被視為多餘。為免生疑問，基金的投資政策並無變更。

6. 新興市場股債、環球股債收息、環球目標回報、環球股債增長收息和可持續發展股債收息 – 澄清投資政策

各基金的投資政策已作出澄清，以規定目標是在包括但不限於全球經濟增長擴大及通脹上升或地緣政治風險加劇期間，或預期信貸息差在經濟增長放緩、利率上升或地緣政治風險加劇期間擴大的情況等市況下暫時利用總回報掉期及差價合約。為免生疑問，各基金的現有慣例（包括衍生工具風險承擔淨額）並無變更。

7. 歐元債券、環球通貨膨脹連繫債券和策略債券 – 澄清投資政策

各基金的投資政策已透過移除有關利用總回報掉期的披露而作出澄清。為免生疑問，各基金的現有慣例（包括衍生工具風險承擔淨額）並無變更。

8. 環球可持續食品及水資源 – 澄清投資政策

基金將其至少 75%的資產投資於可持續投資，即投資經理預期對於全球各地提供可持續食品及水資源（包括水資源管理、農業設備、農業投入品、食品的生產、加工、包裝和分銷、食品及水資源的零售和回收）有貢獻的公司的股本和股本相關證券。基金的投資政策已作出澄清，以規定該等公司透過致力在溫室氣體排放、用水、生物多樣性、物理污染和廢物，以及健康和營養等五個關鍵可持續範疇中至少一個範疇推動正面改變而將其至少 50% 的收入貢獻於提供可持續食品及水資源活動。

9. 環球目標回報 – 澄清投資政策

基金的投資政策已作出澄清，以規定基金將有限度地投資於以人民幣定值的相關投資項目。

10. 亞洲債券、亞幣債券、新興市場債券、歐元債券、歐元流動、環球債券、環球收息債券、環球高收益、環球目標回報、港元債券、策略債券和美元流動 – 更新有關投資於由金融機構發行且具虧損吸收特性的債務工具（「具虧損吸收特性的債務工具」）的投資政策

各基金的投資政策已作出更新，以規定基金可投資於具虧損吸收特性的債務工具（例如：由金融機構的控股公司發行的或有可轉換債券、額外一級、一級及二級資本票據、高級非優先票據、高級及後償債券），並須受限於香港發售文件所披露的最高投資限制。為免生疑問，各基金對具虧損吸收特性的債務工具的現有最高投資參與並無變更。