

施羅德投資管理（香港）有限公司  
香港金鐘道 88 號太古廣場二座 33 字樓

Tel 電話：+852 2521 1633 Fax 傳真：+852 2530 9095  
[www.schroders.com.hk](http://www.schroders.com.hk)

重要提示：此乃重要函件，務須閣下即時垂閱。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」）及其以下子基金（各稱及統稱「子基金」）：

- 施羅德亞洲高息股債基金
- 施羅德亞洲投資級別債券基金
- 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

我們茲致函通知閣下有關於子基金的若干更改或更新，有關更改或更新在下文概述。

#### **A. 施羅德亞洲高息股債基金的投資政策的更改**

由 2021 年 10 月 15 日（「生效日」）起，子基金於亞洲定息證券的預期最低投資額由其資產淨值的 30% 減至 20%。作出此更改後，子基金各資產種類的預計資產配置範圍如下（更改以追蹤修訂顯示）：

亞洲股票：30-70%
亞洲定息收益： <del>30</del> 20-70%
其他資產種類：0-20%
現金和貨幣市場工具：0-30%

預計資產配置僅作參考用途。投資者應注意，實際的配置可不時因應市場、經濟及其他狀況的變動而有所變更。

## B. 信貸評級評估的加強披露

就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及施羅德中國定息基金而言，根據先前的披露，債券／債務證券／定息工具如獲任何中國國內信貸評級機構評為 BB+或以下級別，即屬「低於投資級別」。

由生效日起，就所有子基金而言，債券／債務證券／定息工具如獲任何中國國內信貸評級機構評為 AA-或以下級別，即被視為「低於投資級別」。

此外，所有子基金的投資政策已予釐清，以訂明債券／債務證券／定息工具如獲任何國際認可信貸評級機構（如標準普爾、穆迪或惠譽）評為 BBB-／Baa3（或其相等級別）以下級別，即屬「低於投資級別」。

子基金的經修訂投資政策下「低於投資級別」的涵義概述如下（主要更改以追蹤修訂顯示）：

在購買時評級獲任何國際認可信貸評級機構，如標準普爾、穆迪或惠譽評為 BBB-／Baa3（或其相等級別）以下級別，或由任何中國國內信貸評級機構評為 BB+AA-或以下級別。

再者，所有子基金的投資政策已予加強，以訂明經理人將按照定量和定性的基本因素，包括但不限於發行人的槓桿水平、營業利潤率、資本回報率、利息覆蓋率、營運現金流、行業展望、公司的競爭地位和企業管治事宜，來評估定息工具的信貸風險。

為免生疑問，誠如目前所披露，子基金對低於投資級別的債券／債務證券／定息工具的最高投資參與額並無任何變更。

## C. 與投資於具虧損吸收特性的債務工具相關的釐清

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、施羅德亞洲投資級別債券基金及施羅德中國定息基金的投資政策已作出修訂，以釐清相關子基金可能投資的具虧損吸收特性的債務工具之類型。

相關子基金的投資政策的更改載於下表（更改以追蹤修訂顯示）：

子基金	投資於具虧損吸收特性的債務工具
施羅德亞洲高息股債基金 施羅德中國股債收息基金	子基金可將其資產淨值最多 20%投資於具虧損吸收特性的債務工具，例如：或有可轉換債券、額外一級 <u>資本票據</u> 及二級資本票據、一級及二級資本票據、資本抵押債券、 <u>高級非優先債務</u> 和總虧損吸收能力債券。

施羅德亞洲投資級別債券基金 施羅德中國定息基金	子基金可將其資產淨值最多 30%投資於具虧損吸收特性的債務工具，例如：或有可轉換債券、額外一級 <u>資本票據</u> 及二級資本票據、自救性債券、資本抵押債券、 <u>高級非優先債務</u> 、後償二級資本票據、後償額外一級資本票據及後償較低二級資本票據。
----------------------------	---

為免生疑問，誠如目前所披露，相關子基金對具虧損吸收特性的債務工具的最高投資參與額並無任何變更。

有關相關風險披露，請參閱解釋說明書標題為「風險因素」一節下標題為「與投資於具虧損吸收特性的債務工具相關的風險」的風險因素。

#### D. 其他雜項更新

除上文所載事宜外，解釋說明書及相關子基金的產品資料概要（如適用）亦作出修訂，以包括以下更新，有關修訂由生效日起生效：

- 更新施羅德集團的企業概況；
- 更新經理人董事會成員；
- 更新互聯互通機制及債券通的披露；
- 釐清或加強投資目標及政策；
- 反映有關中華人民共和國（「中國」）的 QFII 及 RQFII 制度的規則及規例近期的更改，包括但不限於 QFII 與 RQFII 制度的合併，以及該等 QFII 及 RQFII 制度現稱為合格境外投資者（「QFI」）制度的更新；
- 反映延伸投資至上海證券交易所科創板（「科創板」）及深圳證券交易所主板與中小企業板（「中小板」）的合併的更新；
- 有關中國投資及監管制度的更新；
- 更新中國稅務披露；
- 加強風險披露；及
- 其他雜項更新、變更及編輯修訂。

#### E. 對單位持有人的影響

除上文所披露者外，子基金的所有其他主要特點，包括費用水平、收費結構、子基金的管理方式及風險概況，將維持不變。上述更改不會對子基金單位持有人的權利或權益造成任何重大損害。

**F. 可供索取文件**

為反映上述更改，解釋說明書及子基金的產品資料概要已作出修訂，並將可於生效日或前後在網站 ([www.schroders.com.hk](http://www.schroders.com.hk)<sup>1</sup>) 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。

**G. 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。

代表

施羅德投資管理（香港）有限公司



曹綺琪

香港區行政總裁

謹啟

2021年10月15日

---

<sup>1</sup> 此網站未經證監會審閱。