

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

重要提示：此乃重要函件，務須閣下垂閱。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，否則本通知書中所用的特定詞彙與基金日期為2018年10月的說明書（經修訂）（「**說明書**」）所界定者具相同涵義。

親愛的單位持有人：

施羅德組合投資基金、施羅德資本平穩基金、施羅德增長基金及施羅德平穩增長基金（各稱「**基金**」及統稱「**各基金**」）

- (I) 反映經修訂《單位信託及互惠基金守則》（「**該守則**」）下的規定之修訂
- (II) 說明書的其他更新

我們茲致函通知閣下有關於各基金的若干變更。下文對「**基金**」的提述分別指施羅德組合投資基金、施羅德資本平穩基金、施羅德增長基金及施羅德平穩增長基金。

A. 背景

基金須遵守香港證券及期貨事務監察委員會（「**證監會**」）所發出的該守則。該守則經已修訂。信託契約將以補充契約（「**補充契約**」）的方式作出修訂，而說明書將以經修訂說明書（「**經修訂說明書**」）的方式作出修訂，以反映經修訂守則下的規定。

B. 根據經修訂守則作出的變更

基金的信託契約及／或說明書（按適當情況而定）將作出以下主要變更，以反映經修訂守則下的規定：

1. **信託人及經理人** – 分別在經修訂守則第 4 章及第 5 章下有關信託人及經理人的額外責任。
2. **投資限制：核心規定** – 就經修訂守則第 7 章下有關投資限制的核心規定及禁制作出的修訂，包括但不限於有關以下各項的修訂：投資分佈、投資於商品的限制、借出貸款限制、借款限制、金融衍生工具、證券融資交易及抵押品等。

根據經修訂守則作出的主要經修訂投資限制／規定摘要載於本通知書附件A。

3. **其他修訂** – 為反映經修訂守則的規定的其他修訂及加強披露，包括以下各項：
 - (a) 為反映經修訂守則中有關與關連人士進行交易及非金錢利益安排的規定之修訂；

- (b) 加強基金資產估值的披露；
- (c) 有關暫停買賣的修訂；及
- (d) 加強於基金終止時處理單位持有人的未領取所得款項的安排的披露。

請參閱有關基金的經修訂說明書及補充契約，以了解進一步詳情。

C. 基金說明書的其他更新

- (a) 由即時起，澄清經理人目前無意就基金訂立任何證券融資交易（即證券借出、銷售及回購交易及逆向回購交易）。
- (b) 將加強披露說明，本基金可投資於其他基金（「基礎計劃」），而該基礎計劃的衍生工具風險承擔淨額高於其最近期可得資產淨值的 50%。對衍生工具風險承擔淨額超逾其資產淨值的 50%的任何單一基礎計劃（為(i)證監會認可的基金（單位信託守則第 8.7 條項下的對沖基金除外）或(ii)未獲證監會認可的合資格計劃^{附註}）的投資將不得超逾本基金資產淨值的 30%。
（附註：「合資格計劃」指在愛爾蘭、盧森堡或英國註冊的可轉讓證券集體投資計劃，而按照彼等當地規例，該等可轉讓證券集體投資計劃可能採取承擔法或風險價值法監控可轉讓證券集體投資計劃的衍生工具風險承擔或風險。）
- (c) 由即時起，每個估值日之相關港元每單位資產淨值及美元累積單位之相關美元每單位資產淨值，均於施羅德的網站（www.schroders.com.hk）或以經理人決定的有關其他適當方式發佈，而非刊登於報章。該網站未經證監會審閱。
- (d) 由即時起，倘經理人宣佈暫停交易，將在(a)任何有關宣佈後立即及(b)在該段暫停期間最少每月一次，於施羅德的網站（www.schroders.com.hk）或以經理人決定的有關其他適當方式刊登通知。該網站未經證監會審閱。
- (e) 基金說明書的其他附帶更新，例如：施羅德集團於世界各地的資產、經理人的董事、服務提供機構的更改、美國法律相關的披露及有關自動交換財務賬戶資料的披露。

D. 變更的影響

除本通知書所披露者外，上述變更（「變更」）將不會導致基金的投資目標及風險概況有任何重大變動。自基金資產支付的應付費用將不會因變更而增加。除本通知書所披露者外，變更亦將不會導致基金目前的經營或管理方式有任何變更。

E. 可供索取文件

有關基金的信託契約連同所有補充契約（包括補充契約）之副本可於正常辦公時間在經理人及信託人的辦事處免費查閱。

F. 查詢

如閣下需要更多資料，請聯絡閣下的慣常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

2019年12月30日

附件 A

主要經修訂投資限制之摘要

投資限制的主要修訂如下：

- (a) 基金透過以下方式投資於任何單一實體或就任何單一實體承擔風險，而本基金所作的投資或所承擔的風險的總值（政府證券及其他公共證券除外）不可超逾其最近期可得資產淨值的 10%：
 - (i) 對該實體發行的證券作出投資；
 - (ii) 透過金融衍生工具的相關資產就該實體承擔的風險；及
 - (iii) 因與該實體就場外金融衍生工具進行交易而產生的對手方風險淨額。
- (b) 根據經修訂守則的規定，本基金透過以下方式投資於同一個集團內的實體或就同一個集團內的實體承擔風險（同一集團內的實體即一般為按照國際認可會計準則擬備綜合財務報表而被納入同一集團內的實體），而本基金所作的投資或所承擔的風險的總值不可超逾其最近期可得資產淨值的 20%：
 - (i) 對該等實體發行的證券作出投資；
 - (ii) 透過金融衍生工具的相關資產就該等實體承擔的風險；及
 - (iii) 因與該等實體就場外金融衍生工具進行交易而產生的對手方風險淨額。
- (c) 基金將現金存放於同一集團內一個或多於一個實體，而該等現金存款的價值不可超逾其最近期可得資產淨值的 20%，惟在經修訂守則訂明的若干情況下可超逾該 20% 的上限。
- (d) 基金不可投資於實物商品，除非證監會經考慮有關實物商品的流通性及（如有必要）是否設有充分及適當的額外保障措施後按個別情況給予批准。
- (e) 根據經修訂守則的規定，基金不可放貸、承擔債務、進行擔保、背書票據，或直接地或或然地為任何人的責任或債項承擔責任或因與任何人的責任或債項有關連而承擔責任。為免生疑問，符合經修訂守則的規定的逆向回購交易，不受本分段所列限制的規限。
- (f) 基金的最高借款將維持為最近期可得資產淨值的 10%。為免生疑問，符合經修訂守則所列規定的證券借出交易和銷售及回購交易不受本分段所列限制的規限。
- (g) 基金可為對沖目的取得金融衍生工具。
- (h) 基金亦可按照其投資目標及政策為非對沖目的而取得金融衍生工具¹，但與該等金融衍生工具有關的風險承擔淨額（「**衍生工具風險承擔淨額**」）不得超逾基金的最近期可得資產淨值的 50%，惟在證監會不時發佈的該守則、手冊、守則及／或指引所准許的情況下或在證監會不時准許的情況下，該限額可能被超逾。

衍生工具風險承擔淨額應根據該守則及證監會發出的規定和指引（可不時予以更新）計算出來。在計算衍生工具風險承擔淨額時，須將為投資目的而取得及會在基金的投資組合層面產生遞增槓桿效應的衍生工具換算成其相關資產的對應持倉。為免生疑問，為對沖目的而取得的金融衍生工具若不會產生任何剩餘的衍生工具風險承擔，該等工具的衍生工具風險承擔將不會計入 50% 限額。

¹ 為免生疑問，目前基金只為對沖目的取得金融衍生工具。