

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各基金日期為2021年1月的解釋說明書（經修訂）（「**解釋說明書**」）所界定者具相同涵義。

親愛的單位持有人：

施羅德金融市場基金
施羅德美元金融基金（統稱「各基金」）

我們茲致函通知閣下有關解釋說明書內標題為「流動性風險管理」一節中作出的一項修正。

A. 背景

由於無意之失，有關經理人可將任何一個交易日可被贖回的單位數目限制至已發行單位總數的10%（「贖回門檻」）作為管理流動性風險的工具的字句（「相關段落」）被載於2018年11月的解釋說明書。

由於各基金的信託契約沒有訂定贖回門檻，相關段落並不適用，我們因此在2021年1月的解釋說明書中從標題為「流動性風險管理」一節移除了相關段落，如下所示：

「流動性風險的管理

經理人已經制定一套流動性管理政策，使之能夠識別、監督和管理本基金的流動性風險，並確保本基金的投資流動性狀況足以讓本基金履行其應付贖回要求的責任。在出現大額贖回時，該政策以及經理人之流動性管理工具亦促使單位持有人得到公平對待和保障餘下單位持有人之利益。

本基金的流動性風險管理是其投資管理程序不可缺少的一部分，是依照施羅德投資風險管理架構運作的。流動性風險管理職能將受施羅德集團風險部門的投資風險職能所監督。集團風險部門將每月編製一份流動性報告。監督的成效將定期向風險管理委員會匯報，風險管理委員會成員包括負責人員；合規、投資和營運及風險部門之管理層和高層員工。流動性風險相關事宜的例外情況將上報至風險管理委員會。

經理人定期評估本基金資產在現時和將來可能出現的市況下的流動性。經理人之流動性政策考慮本基金的投資策略、流動性狀況、贖回政策、交易次數、執行贖回限制的能力和公平估值政策。此等措施為求確保所有投資者得到公平的對待和透明度。

該流動性風險政策包括持續地監督本基金持有之投資狀況，確保該等投資適合標題為「贖回單位」一節內的贖回政策，並促使本基金可以履行其應付贖回要求的責任。再者，流動性管理政策包括經理人在正常和非常市況下，為管理本基金流動性風險而進行的定期壓力測試詳情。

為管理流動性風險，經理人可將任何一個交易日可被贖回的單位數目限制至已發行單位總數的10%（惟須遵守標題為「贖回單位」之條文）。

2021年1月的解釋說明書為最新版本，載於施羅德的網站（www.schroders.com.hk）或可供索取。該網站未經證監會審閱。

B. 影響

我們認為各基金沒有任何單位持有人因相關段落包含在解釋說明書內已受不利影響，因為：

- i. 在有關期間，經理人沒有考慮使用並沒有使用贖回門檻，各基金於任何一個估值日亦沒有發生過贖回單位數目超過各基金已發行單位總數的 10%。
- ii. 各基金沒有遭受任何經濟損失。

此信函僅為提供資訊，閣下毋須就此信函作出回覆。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

2021年5月18日