

此乃重要通知，敬希即時垂注。如有疑問，請尋求專業意見。董事會對本通知所載資料於刊發之日屬準確承擔責任。

東方匯理系列基金
可變資本投資公司
註冊辦事處: 5, Allée Scheffer
L-2520 Luxembourg
R.C.S. de Luxembourg B-68.806
(「本基金」)

貴股東：

謹此通知，我們將對各子基金及本基金和各子基金的香港發售文件（包括說明書及各子基金的產品資料概要）作出下列變動。除非本通知另行界定，本通知的詞彙和用詞均具有本基金和各子基金的香港發售文件所賦予的相同涵義。

1. 環境、社會及管治政策

東方匯理自創立已將負責任投資和企業責任設定為其成立支柱之一，所依據的信念，是經濟和金融參與者對可持續發展社會負有較大的責任，而且環境、社會及管治(ESG)是財務表現的長期動力。

東方匯理認為，除經濟和財務方面外，將 ESG 層面納入投資決策程序可對投資風險和機遇作出更全面的評估。

除納入 ESG 外，東方匯理對所有東方匯理的主動投資策略採用了目標排除政策，排除與 ESG 政策相違背的公司，例如不尊重國際公約、國際認可架構或全國性規例的公司。

東方匯理已依據「同類最優」方法制定出其內部 ESG 評分程序。適配於每個業務界別的評分，旨在評估各公司的營運動態。

ESG 評分和分析在東方匯理的 ESG 分析團隊內進行，亦會用作對決策過程的獨立和互補的輸入。

東方匯理的 ESG 評分是分為七個級別的 ESG 定量分數。級別從 A（最佳分數）至 G（最最差分數）不等，而屬於排除名單的證券相應評分為 G 級。

東方匯理 ESG 評分旨在計量發行人的 ESG 表現，例如發行人對其行業固有的環境、社會及管治風險和時機和個別情況的預計和管理能力。

有關東方匯理 ESG 政策和評分方法的更詳盡資料可於 www.amundi.com.hk 閱覽。請注意，此網址並未經香港證券及期貨事務監察委員會審核。

ESG 投資目標

東方匯理系列基金各子基金（如下文所列）在其投資程序中納入 ESG 因素，並以使投資組合 ESG 評分高於其基準或投資領域（如沒有基準）的 ESG 評分為目標。投資組合 ESG 評分是以東方匯理 ESG 評分模式為依據的發行人 ESG 評分的管理資產加權平均數。此外，除非子基金的投資政策另行訂明，所有東方匯理系列基金子基金均排除所有在東方匯理 ESG 政策的排除名單內的發行人。

從 2021 年 1 月 1 日起，下列子基金的投資政策將予以修訂，以加入旨在使投資組合 ESG 評分高於其各自基準的 ESG 評分的互補目標。

- 東方匯理系列基金 – 歐元貨幣市場基金（此基金並不是香港的貨幣市場基金）*
- 東方匯理系列基金 – 美元貨幣市場基金（此基金並不是香港的貨幣市場基金）*
- 東方匯理系列基金 – 歐元公司債券基金
- 東方匯理系列基金 – 環球可轉換債券基金
- 東方匯理系列基金 – 領先歐洲企業股票基金

* 這是《歐洲貨幣市場基金規例》(EU) 2017/1131 之下的標準可變資產淨值貨幣市場基金。

2. 就東方匯理系列基金 – SBI FM 印度股票基金增加不視作營業日的特定日子

根據說明書，現時任何盧森堡的整個銀行營業日均視作就東方匯理系列基金 – SBI FM 印度股票基金的「營業日」。東方匯理系列基金 – SBI FM 印度股票基金的交易要求若於任何交易日（界定為盧森堡銀行開門營業的營業日）截止時間（若要求由CACEIS HK收到和接受，即香港時間下午5時，或若要求由登記處、過戶代理及付款代理人收到和接受，即盧森堡時間下午2時）前收到（「交易要求」），將按下一個估值日的資產淨值執行。資產淨值將於該估值日計算和公佈。

為確保為股東提供更好的保障及避免東方匯理系列基金 – SBI FM 印度股票基金的購買、轉換或贖回股份要求在東方匯理系列基金 – SBI FM 印度股票基金的主要市場休市之時按未能完全反映公平市價的資產淨值執行，從2021年1月1日起，下表所示國家的公眾假期將不再視作東方匯理系列基金 – SBI FM 印度股票基金的營業日：

子基金	以下國家的公眾假期
東方匯理系列基金 – SBI FM 印度股票基金	盧森堡或印度

在東方匯理系列基金 – SBI FM 印度股票基金的此項變動實施後，上述指定日子將不再是交易日或估值日。於上述指定日子，東方匯理系列基金 – SBI FM 印度股票基金的交易要求將不獲受理，亦不會計算和公佈其資產淨值。

3. 有關基準的披露

根據近期就有關各子基金使用基準的披露資料而發出的監管指導，本公司將對說明書作出若干調整，以改善有關各子基金使用基準的披露。加強披露的目標是幫助投資者了解基準與其子基金的關係。各子基金的投資組合可能或多或少與基準的組成不同，或其目標或採取的措施參照基準受積極管理或作出比較。董事會邀請閣下加以細閱，尤其是那些力求取得優越於基準表現的子基金。

特別是，董事會請股東注意，下列子基金乃設計成參考以下基準而受積極管理，並力求取得優越於基準的表現（在扣除適用費用之後）：

子基金	基準
東方匯理系列基金–中國股票基金	MSCI China 10/40 Index
東方匯理系列基金–新興市場當地貨幣債券基金	JP Morgan GBI-EM Global Diversified Index
東方匯理系列基金–鋒裕環球股票基金	MSCI World Index
東方匯理系列基金–美元綜合債券基金	Bloomberg Barclays US Aggregate Index
東方匯理系列基金–鋒裕美國研究價值股票基金	Russell 1000 Value Index
東方匯理系列基金–領先歐洲企業股票基金	MSCI Europe Index

東方匯理系列基金–中國股票基金的股東應注意，雖然東方匯理系列基金–中國股票基金受全權管理並容許投資於並非列入其基準的發行人，但東方匯理系列基金–中國股票基金主要投資於其基準的發行人，偏離於基準的情況事實上屬有限。

倘若此附加資料可能對你在上文所列任何子基金的投資產生疑慮，閣下可按下文「各項變動的影響」一節贖回或轉換閣下的股份，並無須繳付贖回費或轉換費。

4. 涉及更改東方匯理系列基金–美元貨幣市場基金基準的投資目標和政策的變動

現時，東方匯理系列基金–美元貨幣市場基金的投資目標是「以提供緊貼貨幣市場利率的回報，同時尋求達到與三個月美元銀行同業拆借利率(Libor)相近的穩定表現。」由於三個月美元銀行同業拆借利率(Libor)將於2021年底前逐步停用，從2021年3月1日起，東方匯理系列基金–美元貨幣市場基金的投資目標將改為「提供緊貼貨幣市場利率的回報」。其基準將從三個月美元銀行同業拆借利率(Libor)改為複合聯邦基金有效利率（亦與美元有關）（「**新基準**」），而新基準的使用將在其投資政策下披露。東方匯理系列基金–美元貨幣市場基金仍將受積極管理，並仍然力求達到緊貼新基準的穩定表現。新基準將作後驗使用(即作為評估東方匯理系列基金–美元貨幣市場基金表現的指標)。並沒有相對於新基準的限制會局限東方匯理系列基金–美元貨幣市場基金投資組合的建構。新基準並非用以建構東方匯理系列基金–美元貨幣市場基金的投資組合，而東方匯理系列基金–美元貨幣市場基金的投資風險、表現和回報可能與新基準大相逕庭。

聯邦基金有效利率是一個公眾基準，其官方提供者是美國聯邦儲備。聯邦基金有效利率由美國聯邦儲備系統理事會授權下，使用國內銀行和美國分行及外國銀行代理機構提供的隔夜聯邦基金交易數據計算的利率。新基準是由東方匯理內部計算的聯邦基金有效利率的複合版本，利用隔夜指數掉期方法同時計入每日利息再作投資的影響。

新基準的計算和複合方法

某公曆日（應為平日，即星期一至星期五）(D)的新基準的計算方法，是將上一個公曆日（應為平日）(D-1)的新基準加上一個變數，該變數的計算，是將上一個公曆日(D-1)的新基準乘以某公曆日(D)的聯邦基金有效利率再乘以某公曆日(D)的 DELTA，即從上一次計算以來過去的公曆日日數（包括星期六和星期日）除以360，公式如下：

$$CEFR(D) = CEFR(D-1) + [CEFR(D-1) * (\text{聯邦基金有效利率}(D) * DELTA(D) / 360)]$$

附註：新基準縮寫成「CEFR」以方便閱讀。

一般而言，DELTA 從星期二至星期五是 1，於星期一是 3，以計及沒有進行計算的週末期間過去の日數。東方匯理所用的聯邦基金有效利率是來自 Factset 的代號 FRBRIFSPFF@US。

在上述公式中使用「DELTA」是因為在按月／按季／按年／由年初至今顯示東方匯理系列基金－美元貨幣市場基金的表現時，該等表現將與按月／按季／按年／由年初至今複合計算的一系列每日聯邦基金有效利率作比較。這使東方匯理可考慮以下事實，即東方匯理系列基金－美元貨幣市場基金從過往的投資收取的應計利息均系統性地再作投資。因此，就某特定期間而言，東方匯理系列基金－美元貨幣市場基金的表現與基準的表現相互比較時可以更準確。

以每年 360 日作為基礎計算應計利息是以美元表示的貨幣基金的市場慣例。

新基準的複合計算是按照上述公式長期進行，並不預期有重設機制。該公式的起點數字是 1996 年 1 月 2 日的聯邦基金有效利率。過往選取此日期是為了配合東方匯理所管理的另一隻基金推出之日。

新基準獲選為東方匯理系列基金－美元貨幣市場基金替代三個月美元銀行同業拆借利率(Libor)的原因

新基準獲選為東方匯理系列基金－美元貨幣市場基金的替代基準的原因如下：

- (1) 與現時可用的基準相比，新基準最緊貼東方匯理系列基金－美元貨幣市場基金的相關投資，因為(1)新基準更能反映東方匯理系列基金－美元貨幣市場基金依據隔夜指數掉期方法運用對沖掉期交易；及(2)現時可供選擇的基準是有抵押的基準，而東方匯理系列基金－美元貨幣市場基金主要投資於無抵押的資產（與新基準相符）。
- (2) 新基準符合歐洲議會與歐洲理事會於2016年6月8日頒布的規例(EU) 2016/1011，該規例有關用作金融工具和金融合約基準或用以計量投資基金表現的指數。
- (3) 新基準與東方匯理系列基金－美元貨幣市場基金的理念更為一致，此基金設計為與隔夜存款相似。選擇複合計算、每日將利息資本化的基準是較合理的做法。

三個月美元銀行同業拆借利率(Libor)及新基準

雖然東方匯理系列基金－美元貨幣市場基金仍然受積極管理及仍將力求達到緊貼新基準的穩定表現，投資者應注意，現有基準及建議的新基準依據不同方法計算，因此於某期間某日期的基準數字將有所不同。

於 2020 年 11 月 13 日，三個月美元銀行同業拆借利率(Libor)的數字為 0.222%，而新基準的數字為 0.09%。

在實施此項變動後，東方匯理系列基金－美元貨幣市場基金將參照新基準以上文所述方式予以管理。為免生疑問，除上文所述外，東方匯理系列基金－美元貨幣市場基金的投資政策將維持不變。

由於本節與上文1和3節所述各項變動，東方匯理系列基金－美元貨幣市場基金的投資目標和政策將修訂如下：

「目標

~~提供緊貼貨幣市場利率的回報，同時尋求達到與三個月美元倫敦銀行同業拆借利率（Libor）相近的穩定表現。~~

投資

子基金投資於短期資產，及更確切地，主要投資於以美元計值或與美元對沖的貨幣市場工具。

具體而言，子基金至少以67%資產投資於貨幣市場工具（包括資產抵押商業票據）。子基金的投資組合平均屆滿期維持於90日或以下。

子基金將不會購入超逾 397 日才到期的金融票據，或如果購入政府證券及其他公共證券，則其餘下屆滿期不可超逾兩年。子基金不會以超過 30% 的資產投資於由歐盟內的任何單一國家、公共地方當局或至少一個歐盟成員國所屬的國際組織所發行或保證的貨幣市場工具。

子基金於2020年1月1日起最多可以其資產的10%投資於其他貨幣市場基金的單位／股份。

子基金可投資於吸收虧損工具，例如應急可轉換債務證券、高級非優先債務工具等。在發生觸發事件時，這些工具可能須進行或有減記或或有普通股轉換。預計子基金在吸收虧損工具的最高投資總額以其資產淨值的30%為限。

基準

子基金受積極管理，並力求達到緊貼複合聯邦基金有效利率指數（現時為「三個月美元銀行同業拆借利率（Libor）」，至2021年3月1日為止）（「基準」）的穩定表現。子基金可將基準作後驗使用（即作為評估子基金表現的指標）。並沒有相對於基準的限制會局限投資組合的建構。基準並非用以建構子基金的投資組合，而子基金的投資風險、表現和回報可能與新基準大相逕庭。此外，子基金力求使其投資組合的ESG評分高於其投資範圍的ESG評分。

聯邦基金有效利率是一個公眾基準，其官方提供者是美國聯邦儲備。聯邦基金有效利率由美國聯邦儲備系統理事會授權下，使用國內銀行和美國分行及外國銀行代理機構提供的隔夜聯邦基金交易數據計算的利率。複合聯邦基金有效利率是由東方匯理內部計算的聯邦基金有效利率的複合版本，利用隔夜指數掉期方法同時計入每日利息再作投資的影響。某公曆日（應為平日，即星期一至星期五）(D)的複合聯邦基金有效利率計算方法，是將上一個公曆日（應為平日，(D-1)）的複合聯邦基金有效利率加上一個變數，該變數的計算，是將上一個公曆日(D-1)的複合聯邦基金有效利率乘以某公曆日(D)的聯邦基金有效利率再乘以某公曆日(D)的DELTA，即從上一次計算以來過去的公曆日日數(包括星期六和星期日)除以 360，公式如下：

$$CEFR(D) = CEFR(D-1) + [CEFR(D-1) * (\text{聯邦基金有效利率}(D) * DELTA(D) / 360)]$$

附註：複合聯邦基金有效利率縮寫成「CEFR」以方便閱讀。

一般而言，DELTA 從星期二至星期五是 1，於星期一是 3，以計及沒有進行計算的週末期間過去の日數。東方匯理所用的聯邦基金有效利率是來自 Factset 的代號 FRBRIFSPFF@US。

在上述公式中使用「DELTA」是因為在按月／按季／按年／由年初至今顯示子基金的表現時，該等表現將與按月／按季／按年／由年初至今複合計算的一系列每日聯邦基金有效利率作比較。這使東方匯理可考慮以下事實，即子基金從過往的投資收取的應計利息均系統性地再作投資。因此，就某特定期間而言，子基金的表現與基準的表現相互比較時可以更準確。

以每年 360 日作為基礎計算應計利息是以美元表示的貨幣基金的市場慣例。

複合聯邦基金有效利率的複合計算是按照上述公式長期進行，並不預期有重設機制。該公式的起點數字是 1996 年 1 月 2 日的聯邦基金有效利率。過往選取此日期是為了配合東方匯理所管理的另一隻基金推出之日。

衍生工具

子基金可運用衍生工具作對沖的用途。子基金不會投資於金融衍生工具作投資用途。

子基金的衍生工具風險承擔淨額以其資產淨值的 50% 為限。」

5. 東方匯理系列基金–領先歐洲企業股票基金投資政策的變動

現時東方匯理系列基金–領先歐洲企業股票基金的部分投資政策是至少以其資產的75%投資於總部設於歐盟的公司所發行的股票。由於英國預期即將脫離歐盟，東方匯理系列基金–領先歐洲企業股票基金將不再能符合前述的部分投資政策。因此，從2021年1月1日起，前述部分的投資政策將予以移除。

在實施此項變動後，東方匯理系列基金–領先歐洲企業股票基金現時的管理方式將改變，將會按照新的投資政策進行管理。因此，應注意的是，東方匯理系列基金–領先歐洲企業股票基金將無須再以其投資組合的任何部分投資於總部設於歐盟的公司。然而，預期此項變動在不久的將來並不會導致東方匯理系列基金–領先歐洲企業股票基金的現行投資組合有任何重大變動，因為此項變動的推動，是由於投資經理擬保留東方匯理系列基金–領先歐洲企業股票基金的現有英國股票持倉而無須被逼予以平倉。

為了清楚闡明，在此項變動後，東方匯理系列基金–領先歐洲企業股票基金將主要（即至少以淨資產值的50%但以100%為限）投資於市值30億歐元或以上且總部設於歐洲或在歐洲經營大部分業務的中型及大型資本公司所發行的股票。一般預期東方匯理系列基金–領先歐洲企業股票基金將至少以其資產淨值的67%投資於該等股票。

由於本節與上文1和3節所述各項變動，東方匯理系列基金–領先歐洲企業股票基金的投資目標和政策將如下：

「目標

為閣下的投資增值。

投資

子基金主要（即至少以淨資產值的 50% 但以 100% 為限）投資於市值 30 億歐元或以上且總部設於歐洲或在歐洲經營大部分業務的中型及大型資本公司所發行的股票。一般預期東方匯理系列基金–領先歐洲企業股票基金將至少以其資產淨值的 67% 投資於該等股票。~~子基金至少以其資產的 75% 投資於總部設於歐盟的公司所發行的股票。~~雖然子基金可能投資於該經濟體的任何地區，但其持股在任何特定時間可能集中於相對少數目的公司。

子基金可以最多10%的資產投資於其他UCI及UCITS。

子基金不擬將超過其淨資產值的 10% 投資於由單一主權國發行人（包括其政府、該國的公共或地方當局）發行及/或保證而且低於投資級或無評級的證券。

基準

子基金參照MSCI Europe Index (「基準」) 受積極管理，並力求取得優越於基準的表現（在扣除適用費用之後）。子基金主要投資於基準的發行人，但子基金受全權管理，並將投資於並非列入基準的發行人。子基金監控其就基準所承擔的風險，但預期會在重大程度上偏離於基準。此外，子基金力求使其投資組合的ESG評分高於基準的ESG評分。

衍生工具

子基金可運用衍生工具以減低各種風險，作有效投資組合管理及作為取得參與投資（長倉或短倉）於各種資產、市場或其他投資機會（包括集中於股票的衍生工具）的方式。

子基金的衍生工具風險承擔淨額以其資產淨值的 50% 為限。」

6. 東方匯理系列基金–亞洲智選股票基金投資政策的變動

從2021年1月1日起，東方匯理系列基金–亞洲智選股票基金的投資政策將予以修訂，以便可以透過人民幣合格境外機構投資者的資格投資於中國A股。

由於本節與上文1和3節所述各項變動，子基金的投資目標和政策將如下：

「目標

以達到長期資本增長為目標。具體而言，子基金力求（在扣除適用費用之後）取得優越於 **MSCI AC Asia ex Japan** 指數的表現。

投資

子基金主要投資於亞洲（日本除外）股票。

具體而言，子基金至少以67%資產投資於其總部或主要業務設於亞洲（不包括日本但包括中國）的公司的股票及股票掛鈎票據。中國股票投資可透過香港的認可市場或透過股票市場交易互聯互通機制進行。子基金亦可以透過人民幣合格境外機構投資者的資格投資於中國A股。子基金最多可以其淨資產的10%投資於中國A股及B股（綜合計算）。這些投資並未設定貨幣限制。

在奉行上述政策的同時，子基金餘下的淨資產亦可投資於其他股票、股票掛鈎票據、可轉換債券、債券、貨幣市場工具和存款，並可以最多10%的淨資產投資於UCITS/UCI。

基準

子基金參照MSCI AC Asia ex Japan Index (「基準」)受積極管理，並力求取得優越於基準的表現（在扣除適用費用之後）。子基金主要投資於基準的發行人，但子基金受全權管理，並將投資於並非列入基準的發行人。子基金監控其就基準所承擔的風險，但預期會在重大程度上偏離於基準。子基金將持有較基準集中的投資組合。與基準的相關性程度或會限制投資組合的表現偏離於基準的程度。

衍生工具

子基金可運用衍生工具作對沖及有效投資組合管理的用途。

子基金的衍生工具風險承擔淨額以其資產淨值的50%為限。」

7. 股份轉換安排的變動

現時只要投資者遵守其擬轉入的股份類別的所有持股和資格要求，即可將其持有的子基金某類別股份轉換為同一或不同子基金的另一類別股份，惟東方匯理系列基金–中東北非基金不允許進行股份轉換（轉入及轉出）。

本基金現時的做法是不同子基金可設定不同時間依據本基金的計算政策計算其資產淨值。因此，在一些子基金已完成計算資產淨值的程序之時，其他子基金可能剛開始計算程序，因此計算資產淨值時間不同的子基金之間的轉換要求必須推遲至所有相關的資產淨值均可提供之時為止。為了避免上述營運困難，董事會已決定只允許計算資產淨值時間相同的子基金互相進行股份轉換。

因此，從2021年1月1日起，投資者只可將其股份轉入或轉出同一組別(A、B或C)內的子基金，詳見下文所示。

A組	所有子基金，惟以下B、C組的子基金除外
B組	東方匯理系列基金 – 歐元貨幣市場基金
C組	東方匯理系列基金 – 美元貨幣市場基金

由於此項變動，東方匯理系列基金 – 歐元貨幣市場基金和東方匯理系列基金 – 美元貨幣市場基金將不允許進行轉換（轉入及轉出），因為如上文所示在其各自組別內並沒有本基金其他獲證監會認可的子基金¹。另外，由於東方匯理系列基金–中東北非基金將列入A組，東方匯理系列基金–中東北非基金將獲允許與A組另一子基金進行轉換（轉入及轉出）。

此外，在實施此項變動後，如投資者欲將其某一組子基金的股份轉換為另一組子基金的股份，須首先贖回其現有子基金的股份，然後再認購其他子基金的股份，並應注意適用的贖回費及 / 或認購費。

為免生疑問，東方匯理系列基金說明書內就股份轉換詳列的其他條件將維持不變。

8. 增加東方匯理系列基金 – 美元貨幣市場基金若干股份類別的最高管理費

作為本基金管理公司為更緊貼市場利率而作出的商業決定，從2021年1月1日起，東方匯理系列基金–美元貨幣市場基金下列股份類別的最高管理費將如下表所示有所增加。然而，即使將增加最高管理費，東方匯理系列基金 – 美元貨幣市場基金的受影響股份類別的管理費在不久將來將維持不變。

子基金	股份類別	現行最高管理費 (資產淨值年率)	新的最高管理費 (資產淨值年率)
東方匯理系列基金 – 美元貨幣市場基金	I2 美元 (C)	0.10%	0.12%
	I2 美元 AD (D)	0.10%	0.12%

股東應注意，上述增費是關乎現行管理費於任何時候可能達到或未達到的一個潛在的最高收費。

9. 調減東方匯理系列基金–東協焦點市場基金的最高行政費用

從 2019 年 6 月 1 日起，東方匯理系列基金–東協焦點市場基金的下列股份類別最高行政費用已如下表所示有所調減。

子基金	股份類別	之前的最高行政費用 (資產淨值年率)	新的最高行政費用 (資產淨值年率)
東方匯理系列基金–東協焦點市場基金	A2 美元 (C)	0.50%	0.30%
	A2 美元 AD (D)	0.50%	0.30%

10. 闡明有關浮動定價通知的公佈方式

一般而言，當某一子基金於任何估值日的認購和贖回淨額大於子基金資產的預設的百分率上限（將由董事會每季釐定和檢討）時，資產淨值將上調或下調不超過原資產淨值的2%。董事會將定期檢討此調整限額，

¹ 證監會認可不等如對某項計劃作出推介或認許，亦不是對某項計劃的商業利弊或表現作出保證，更不代表該項計劃適合所有投資者，或認許其適合任何個別投資者或任何類別的投資者。

如為保障現有股東權益而認為有必要，可決定提高此調整限額。董事會欲闡明，如提高此調整限額，股東將獲通知，通知將在<http://www.amundi.com.hk/retail>刊發。此網址並未經證券及期貨事務監察委員會審核。

各項變動的影響

除本通知另行規定外，本通知所述有關各子基金的變動將不會對各子基金的投資目標和政策、投資組合以及本基金及各子基金的整體風險概況造成任何重大的影響。除上文第8節所述變動外，各子基金的收費結構和水平及各子基金的管理費用在其他變動實施之後均沒有改變。預期該等變動將不會對股東的權利和利益造成重大損害。除本通知所述各項變動外，本基金及各子基金現行經營及 / 或管理方式並沒有任何其他變動。

根據適用法律及組織章程細則的規定，本通知所述有關各子基金的變動並無須經由股東批准。

任何與本通知所述對各子基金所作變動有關的費用及支出將由本基金的管理公司承擔。

閣下若不同意對所持有的各子基金作出變動，有權從本通知日期起於2021年1月1日香港時間下午5時之前，按照現行說明書所訂明的贖回和轉換程序和安排贖回閣下的股份或將閣下的股份轉換為本基金在香港獲證監會認可的其他子基金²的任何其他股份類別（惟該等股份類別須符合現行說明書附錄I就每種股份類別訂明的特定要求），無須繳付贖回費或轉換費（東方匯理系列基金–美元貨幣市場基金除外，由於上文第4節所述變動，閣下有權於2021年3月1日香港時間下午5時之前按照上文所述方式贖回或轉換閣下的股份，無須繳付贖回費或轉換費）。為免生疑問，此項安排仍適用於受上文第7節所述變動影響的各子基金的股東。請注意，雖然我們將不會就閣下的贖回 / 轉換指示收取任何費用，但閣下的銀行、分銷商、財務顧問或退休計劃的信託人或管理人可能向閣下收取贖回 / 轉換及 / 或交易費用，並可能設有不同的交易安排。如有任何問題，建議聯絡閣下的銀行、分銷商、財務顧問或退休計劃的信託人或管理人。

香港發售文件將在適當時候予以修訂，以反映上述各項變動。最新的香港發售文件在本基金的註冊辦事處及香港代理人的辦事處（地址為香港金鐘道 88 號太古廣場第一期 901-908 室）可供免費索取。最新的香港發售文件亦可於此網址閱覽：<http://www.amundi.com.hk>。請注意，此網址並未經證監會審核。

如欲取得任何進一步資料，請致電 (852) 2521 4231聯絡香港代理人東方匯理資產管理香港有限公司。

此致

董事會

盧森堡，2020年11月30日

² 證監會認可不等如對某項計劃作出推介或認許，亦不是對該計劃的商業利弊或表現作出保證，更不代表該計劃適合所有投資者，或認許該計劃適合任何個別投資者或任何類別的投資者。

發行人：東方匯理資產管理香港有限公司

2020 年 9 月

- 本概要提供本基金的重要資料。
- 本概要是說明書的一部分。
- 請勿單憑本概要作出投資決定。

資料便覽

管理公司：	Amundi Luxembourg S.A.	
投資經理：	Amundi (UK) Limited (英國，內部轉授)	
存管處：	CACEIS Bank, Luxembourg Branch	
交易頻密程度：	每日 (盧森堡的銀行開門營業的整個工作天)	
全年經常性開支比率*：	A2 美元 - 累積	1.36%
	A2 美元 - 每年派息	1.36%
基本貨幣：	美元	
派息政策：	派息股份：若宣佈派息，將支付股息 [^] 累積股份：不會宣佈派息 [^] 東方匯理系列基金可全權酌情決定從本基金的收入及/或資本支付股息，或從總收入中支付股息而同時於/從本基金的資本記入/支付本基金全部或部分費用及支出，以致本基金用作支付股息的可分派收入增加，而因此本基金實際上可從資本支付股息。從資本分派股息或實際上從資本支付股息可能導致本基金的每股資產淨值即時減少。	
財政年度終結日：	6 月 30 日	
最低投資額：	首次：沒有	其後：沒有

*經常性開支比率是以 2019 年 7 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日期間的開支，以及其相應期間的平均資產淨值經年率化作百分比顯示。有關數據或會按年變動。

本基金是甚麼產品？

本基金是東方匯理系列基金之子基金。東方匯理系列基金以互惠基金形式在盧森堡組成，其監管機構為盧森堡金融業監管委員會 (Commission de Surveillance du Secteur Financier)。

投資目標

以達到結合收益及資本增長 (總回報) 為目標。特別是，本基金力求 (在扣除適用費用之後) 取得優越於 JP Morgan Government Bond Global All Maturities Unhedged in USD 指數的表現。

投資策略

本基金主要投資於由經合組織成員國的發行人所發行的投資級債券。

特別是，本基金至少以 67% 資產投資於由經合組織成員國政府或超國家機構發行或保證 (至少佔資產的 60%) 或由公司實體發行的投資級債券。這些投資並未設定貨幣限制。

本基金可將其淨資產的最多 20% 投資於資產抵押證券/按揭證券。本基金主要投資於債券和貨幣 (間接透過金融衍生工具)。本基金積極持有的貨幣倉盤未必與本基金的相關資產 (即債券) 互相對應。

本基金可投資於具有吸收虧損特性的債務工具 (「吸收虧損工具」)，例如應急可轉換債務證券、高級非優先債務工具等。在發生觸發事件時，這些工具可能須進行或有減記或有普通股轉換。預計本基金在吸收虧損工

具的最高投資總額將少於其資產淨值的 30%。本基金在應急可轉換債券的投資以淨資產的 10%為限。

金融衍生工具的運用

本基金可運用衍生工具以減低各種風險，作有效投資組合管理及作為取得參與淨額投資（長倉或短倉）於各種資產、市場或其他投資機會（包括集中於信貸、利息及外匯的衍生工具）的方式。本基金將投資於金融衍生工具作投資用途（例如貨幣投資管理，積極的存續期管理，及創設對發行人的合成投資），但這並不僅限於特定的金融衍生工具運用策略。該等金融衍生工具可包括在場外及/或交易所買賣的期權、期貨、認股權證、掉期交易、遠期合約。本基金可運用信貸衍生工具（例如單一發行人掉期及指數信貸違約掉期，最多以淨資產的 40%為限）。

基金可透過運用金融衍生工具產生槓桿作用。總槓桿率預期約佔基金資產淨值的 900%。預期槓桿率為一項指標而非監管限制。當利率預期將大幅變動，信貸息差預期將大幅擴闊或收窄，或當市場波動非常低時，預期槓桿率可能會上升。

運用衍生工具 / 投資於衍生工具

子基金的衍生工具風險承擔淨額可能超過子基金資產淨值的 100%。

本基金有哪些主要風險？

投資涉及風險。請參閱說明書，了解風險因素等資料。

- 1. 利率風險：**本基金之資產淨值將受利率波動的影響。當利率下調，固定收益證券的市值將相應上升，反之亦然，利率上升會導致本基金的投資減值。
- 2. 信貸風險：**本基金或會投資於固定收益證券。若固定收益證券之發行人無法履行其義務，本基金將無法收回其投資。
- 3. 預付風險：**本基金因投資債券及/或債務工具，而有機會承受利率一旦下調時債務人或按揭人償還債務的風險（即以較低的現行利率進行再融資），因而迫使本基金須進行再投資而獲得較低的利率回報。
- 4. 與運用金融衍生工具有關的風險：**本基金將大量投資於金融衍生工具作對沖和投資用途。概不能保證金融衍生工具的表現會對本基金產生正面的作用。在不利的市況下，本基金運用金融衍生工具進行對沖/投資未必奏效，本基金或會蒙受巨額損失。投資金融衍生工具還須承受額外風險，包括：

信貸風險及對手方風險—本基金若經由對手方或與對手方進行金融衍生工具交易，將須承受對手方因資不抵債、破產等原因而不能履行責任的風險，並因此令本基金受對手方的信貸能力及履行和完成其財務責任的能力的影響。對手方的任何失責均可能導致本基金蒙受財務損失。

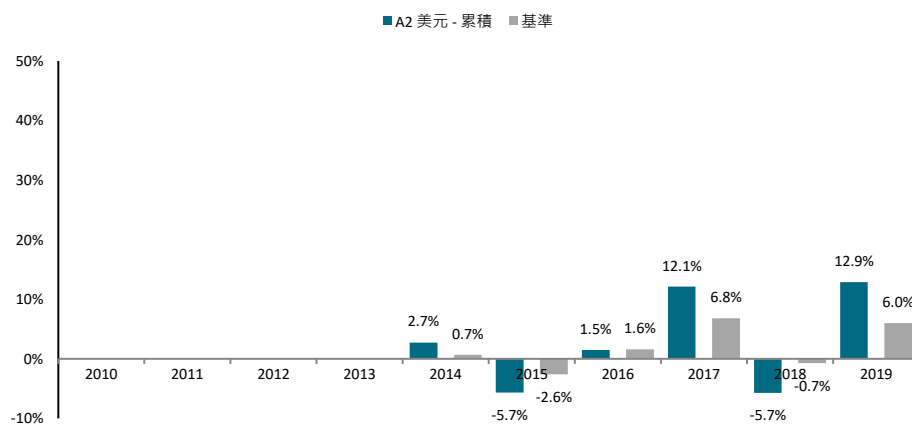
流動性風險—任何金融衍生工具於任何時候均可能缺乏具流動性的第二市場。本基金可能無法在有利的時間或以有利的價格出售交投淡靜的金融衍生工具，從而對本基金的價值造成不利的影響。

估值風險—本基金須承受金融衍生工具定價錯誤或估值不當的風險，這可能對本基金的價值造成不利的影響。

波動風險—金融衍生工具若與其相關投資相比，波動程度較高而流動性較低，這可能對本基金的價值造成不利的影響。
- 5. 信貸違約掉期風險：**本基金或會因購入信貸違約掉期而承受較高度度的信貸風險。由於本基金可作為保障賣方而持有信貸違約掉期，在信貸違約掉期的參考資產發生不利的信貸事件時，本基金須彌補參考資產的貶值額，或會蒙受損失。
- 6. 降級風險：**債務證券或其發行人的信貸評級可能承受被降級的風險。如證券或證券發行人的信貸評級被降級，本基金在該證券的投資價值可能受到不利的影響，從而影響基金價值。有關投資經理可能沽售或不沽售該等被降級的債務證券。
- 7. 匯率風險：**本基金可能有大量貨幣持倉，因此本基金須承受匯率風險。相關資產(即債券)的計值貨幣可能並非本基金的基本貨幣，因此貨幣匯率的走勢可能對本基金的價值產生不利的影響。由於本基金積極持有的貨幣倉盤未必與本基金的相關資產(即債券)互相對應，在貨幣走勢不利的情況下，即使本基金投資的相關資產(即債券)的價值並未下跌，本基金仍可能蒙受重大損失，因此投資者亦可能蒙受損失。
- 8. 高槓桿風險：**本基金的金融衍生工具投資的淨額槓桿比率超過其資產淨值的 100%。在不利的市況下，這可能導致本基金的資產遭受重大損失或全盤虧損。

9. 從資本支付股息的相關風險：就派息股份類別而言，東方匯理系列基金可酌情決定以本基金的收入或資本支付股息。此外，東方匯理系列基金可酌情決定從總收入中支付股息而同時於/從本基金的資本記入/支付本基金全部或部分費用及支出，以致本基金用作支付股息的可分派收入增加，而因此本基金實際上可從資本支付股息。以資本支付股息相當於退還或提取投資者部分原有之投資或任何歸屬於該原有投資的資本收益。任何涉及從本基金的資本中支付股息或實際上從本基金的資本中支付股息（視情況而定）均可導致本基金每股資產淨值即時減少。東方匯理系列基金可更改從本基金的資本或實際上從本基金的資本中支付股息的派息政策，但須經證監會事先批准。有關派息政策改變，受影響的股東會獲發至少一個月事先通知。

本基金的過往表現如何？



從 2014 年 6 月 2 日起，基金的投資目標和政策被修訂，並加入基準更準確地反映現行的投資方式。

從 2019 年 10 月 1 日起，Amundi (UK) Limited 獲委任接替 Amundi Asset Management 擔任基金的投資經理。

- 往績並非預測日後業績表現的指標。投資者未必能取回全部投資本金。
- 本基金業績表現以歷年末的資產淨值作為比較基礎，股息會滾存再作投資。
- 投資經理視「A2 美元-累積」作為本基金可供香港零售投資者認購的核心股份類別為最合適的代表股份類別。
- 上述數據顯示本股份類別總值在有關歷年內的升跌幅度。業績表現以美元計算，當中反映出本基金的持續費用，但不包括本基金可能向閣下收取的認購費及贖回費。
- 如年內沒有顯示有關的業績表現，即代表當年沒有足夠數據用作提供業績表現之用。
- 本基金之基準為「JP Morgan Government Bond Global All Maturities Unhedged in USD」指數。
- 基金成立日期: 1990 年
- 類別成立日期: 2013 年。

本基金有否提供保證？

本基金並不提供任何保證。閣下未必能取回投資本金。

投資本基金涉及哪些費用及收費？

閣下或須繳付的收費

基金股份交易或須繳付以下費用。

費用	金額
認購費	不多於認購額的 4.50%
轉換費	不多於轉換額的 1.00%
贖回費	沒有

基金持續繳付的費用

以下收費將從本基金中扣除，閣下的投資回報將會因而減少。

每年收費率（佔基金總值百分比）

管理費	0.90%（最高）
存管費	包括在行政費用內
表現費	不適用
行政費	0.20%（最高）

其他費用

基金股份交易或須繳付其他費用。本基金亦將承擔說明書所述直接歸屬於本基金的費用。

其他資料

- 於交易截止時間即下午五時（香港時間）或之前經處理香港買賣指示的香港服務供應商東方匯理香港信託有限公司收妥的股份認購及贖回要求，一般按本基金隨後釐定的資產淨值執行。投資者宜謹記，分銷商各有不同的截止時間，請留意不同分銷商的交易截止時間。
- 本基金在每一營業日計算資產淨值，並於網站<http://www.amundi.com.hk/retail>*公佈有關股份價格。
- 本基金銷售予香港投資者的代表股份類別之過往表現資料可向東方匯理資產管理香港有限公司索閱，而有關資料的英文版本亦可於以下網站閱覽：<http://www.amundi.com.hk>*。
- 過去十二個月的股息成分資料（即從(i)可分派淨收入及(ii)資本支付的相對款額）可向東方匯理資產管理香港有限公司索閱，亦可於以下網站閱覽：<http://www.amundi.com.hk>*。

*上述網站並未經證監會審核。

重要提示

閣下如有疑問，應諮詢專業意見。

證監會對本概要的內容並不承擔任何責任，對其準確性或完整性亦不作出任何陳述。