

施 羅 德 證 券 投 資 信 託 股 份 有 限 公 司

函

地址：台北市信義路5段108號9樓
聯絡電話：(02) 8723-6888

受文者：各銷售機構/保險公司

發文日期：中華民國 107 年 9 月 17 日

發文字號：施羅德業字第 107059 號

附件：境外基金公司通知信

主旨：茲通知施羅德傘型基金 II-施羅德亞洲高息股債基金（「本基金」）相關變更
乙事，詳後說明，請 查照。

說明：

一、 本基金將自 2018 年 10 月 19 日（「生效日」）起進行以下變更：

1. 稀釋與稀釋調整：本基金因採取單一定價，可能會因認購、贖回及/或轉換而導致買賣投資項目的交易費用及買賣差價而使基金價值下跌，此稱為「稀釋」。

為應付該等情況及保障投資人權益，自生效日起，經理人將採取「稀釋調整」作為每日估值政策之一部分。「稀釋調整」是根據該本基金投資項目的交易費用，包括買賣差價而計算，而該等因素視市況而變動，故稀釋調整的數量會不時變動，但不會超過本基金於估值日每單位資產淨值的 2%。

2. 依據香港證監會修改之《基金經理操守準則》（「基金經理準則」）修訂公開說明書：香港證監會對基金經理準則作出修改，該修改包括資產管理公司就所管理基金相關槓桿比率、證券借貸、回購交易、逆回購交易、流動性風險管理及其他風險管理政策有揭露義務。為反映修改後之基金經理準則規定，本基金之公開說明書及信託契約將予修訂。

二、 除上述變更外，本基金其他主要特點，包含收費標準、收費結構、管理方式及風險概況等均維持不變。

三、 謹請 查照轉知。

總經理 巫 慧 燕

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：此乃重要文件，務須閣下即時垂閱。閣下如對本函件的內容有任何疑問，應尋求找獨立專業意見。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。

親愛的單位持有人：

施羅德傘型基金 II（「本基金」）及其以下各子基金（「各子基金」）：

- 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
- 施羅德中國定息基金
- 施羅德環球配置基金

我們茲致函通知閣下若干有關各子基金的更改，有關更改概述於下文。此等更改將由 2018 年 10 月 19 日（「生效日期」）起生效。

除非另有指明，否則本函件中所用的特定詞彙與每項子基金的解釋說明書（「解釋說明書」）所界定者具相同涵義。

• **攤薄及攤薄調整**

每一子基金使用單一定價，基金可能會因認購、贖回及/或轉換所導致買賣旗下投資項目的交易費用及買賣差價使基金價值下跌，此稱為「攤薄」。為應付該等情況及保障單位持有人利益，由生效日期起，經理人將引入「攤薄調整」作為其每日估值政策之一部分。因而在某些情況下，經理人（如其本著真誠認為此舉乃符合單位持有人的利益）將調整計算每單位資產淨值，以應付交易及其他費用帶來的重大影響。

在一般業務過程中，攤薄調整機制將機械地啟用及貫徹使用。

是否需要進行攤薄調整視乎子基金於各交易日所收到的認購、轉換及贖回要求的淨值而定。因此，當子基金的淨現金流動與前一個交易日的資產總淨值比較，超過某個經理人不時訂定的限額，經理人保留進行攤薄調整的權利。

若經理人認為符合現有單位持有人的利益，亦可酌情地使用攤薄調整機制。

在進行攤薄調整時，如子基金有淨資金流入，每單位資產淨值將提高；如有淨資金流出，每單位

資產淨值將調低。各子基金各類別單位資產淨值將分別計算，惟任何攤薄調整將按同樣比例影響各類別單位的每單位資產淨值。

由於攤薄與子基金的資金流入及流出有關，因此不可能準確地預測攤薄何時發生，故此亦不可能準確地預測經理人進行該等攤薄調整的次數。

子基金的攤薄調整是根據該子基金旗下投資項目的交易費用，包括任何買賣差價而計算，該等因素視市況而變動，故攤薄調整的數目亦不時變動，但不會超過相關子基金於相關估值日每單位資產淨值的 2%。

為了反映上文所載有關更改，每項子基金的解釋說明書及本基金信託契約（「**信託契約**」）將予修訂。

除了上文所載述外，各子基金的所有其他主要特點，包括收費水平、收費結構、各子基金的管理方式及風險概況均維持不變。就此等更改而引起的費用，包括修訂解釋說明書及信託契約的法律費用，每項子基金的法律費用估計為 30,000 港元，並將由相關子基金承擔。

• **根據經修改的《基金經理操守準則》對解釋說明書作出的修訂**

經理人按照香港證券及期貨事務監察委員會（「證監會」）獲發牌從事第 9 類（提供資產管理）的受規管活動，並受證監會的規定規限，包括證監會的《基金經理操守準則》（「基金經理準則」）。證監會對基金經理準則作出了修改，包括從事第 9 類牌照受規管活動的公司就其管理的基金的某些披露義務。該披露義務有關槓桿比率、證券借貸、回購交易、逆回購交易、流動性風險管理及其他風險管理政策。

每一子基金的解釋說明書將作修訂以反映經修改的基金經理準則的規定。

每項子基金的經修訂解釋說明書（包括產品資料概要）將可於生效日期或前後提供。經修訂的解釋說明書及產品資料概要的副本將可應要求提供。

本基金的經修訂信託契約將可於生效日期或前後提供。該等信託契約（經修訂）的副本可於支付一項合理費用後取得，並可於正常辦公時間內在經理人及受託人的辦事處免費查閱。

閣下如需要更多資料，請聯絡閣下的專業顧問或致電施羅德投資熱線電話：(+852) 2869 6968 查詢。



杜偉麒

香港區行政總裁

施羅德投資管理（香港）有限公司

謹啟

2018 年 9 月 17 日