此乃重要通知，敬希即時垂注。如有疑問，請諮詢專業意見。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**」)

尊敬的股東：

我們謹此通知閣下各子基金以及本基金及各子基金的香港銷售文件（包括說明書及各子基金的產品資料概要）將作出以下變動。除非本通知另有界定，否則本通知所用詞彙及用語具有本基金及各子基金的香港銷售文件所賦予之相同涵義。

1. 東方匯理系列基金 - 歐元高回報債券基金（就本節而言稱為「子基金」）的投資政策的非重大變動

自2022年6月8日起，子基金的投資政策及管理程序將修訂如下：

(1) 目前，子基金的投資政策規定，子基金未指定其基準（即 ML European Curr H YLD BB-B Rated Constrained Hed 指數）作為就披露條例而言的參考基準。子基金的投資政策將予修訂，以反映子基金已指定其基準作為就披露條例而言的參考基準。基準為寬基市場指數，並不根據環境特點作出評估或納入其成分股，因此不符合子基金倡導的環境特點。關於用於計算基準方法的資料刊登於 www.amundi.com.hk。此網站未經證監會審核。

(2) 目前，子基金的管理程序規定，子基金力求使其投資組合的ESG評分高於投資範圍的ESG評分。子基金的管理程序將予修訂，以反映子基金力求使其投資組合的 ESG 評分高於其基準的 ESG 評分。在釐定子基金及其基準的 ESG 評分時，ESG 表現乃透過針對環境、社會及管治三個 ESG 特點的每一項，將一隻證券與證券發行人所在行業的平均表現進行比較來評估。透過使用東方匯理的 ESG 評級方法選擇證券時，會根據子基金的性質考慮投資決策對可持續發展因素的主要不利影響。關於東方匯理的 ESG 評級方法的更多詳細資料，請參閱說明書「附錄 V：可持續投資」。

2. 東方匯理系列基金 - SBI FM 印度股票基金（就本節而言稱為「子基金」）的投資政策的非重大變動

自2022年6月8日起，子基金的投資政策及管理程序將修訂如下：

(1) 子基金的投資政策將予修訂，以反映其為依據披露規例第 8 條倡導 ESG 特點的金融產品。

(2) 此外，子基金的投資政策將予修訂，以反映子基金已指定其基準（即 MSCI India 10/40 指數）作為就披露條例而言的參考基準。基準為寬基市場指數，並不根據環境特點作出評估或納入其成分股，因此不符合子基金倡導的環境特點。關於用於計算基準方法的資料刊登於 www.amundi.com.hk。此網站未經證監會審核。

(3) 子基金的管理程序將予修訂，以：

(i) 納入補充性目標，力求使其投資組合的 ESG 評分高於其基準的 ESG 評分。在釐定子基金及其基準的 ESG 評分時，ESG 表現乃透過針對環境、社會及管治三個 ESG 特點的每一項，將一隻證券與證券發行人所在行業的平均表現進行比較來評估。透過使用東方匯理的 ESG 評級方法選擇證券時，會根據子基金的性質考慮投資決策對可持續發展因素的主要不利影響。關於東方匯理的 ESG 評級方法的更多詳細資料，請參閱說明書「附錄 V：可持續投資」；及

(ii) 反映披露規例及分類法規例下的若干監管披露規定。

3. 擴闊東方匯理系列基金 - 美元綜合債券基金（就本節而言稱為「子基金」）的投資政策

(1) 有關子基金對資產抵押證券（ABS）及按揭證券（MBS）的參與投資上限的加強披露

考慮到子基金的投資經理所運用的策略可能包含對資產抵押證券和按揭證券的重大參與投資，子基金的投資政策將新增有關其對此等資產的投資百分比上限的補充披露 。

尤其是，子基金目前的投資政策規定，其最多可以其資產淨值的70%投資於資產抵押證券及按揭證券。子基金的投資政策將予以加強，以反映上述參與投資包含透過待定（TBA）證券作出的間接參與投資，其以子基金資產淨值的50%為限。對非機構按揭證券和資產抵押證券的參與投資，以子基金資產淨值的50%為限。

說明書中第V章「 投資目標及政策」的「一般投資風險」一節中的風險因素「按揭證券（「MBS」）／資產抵押證券（「ABS」）投資風險」亦將加強如下：

「*按揭證券是代表以按揭抵押的匯集貸款權益的證券。資產抵押證券是在金融市場買賣並以金融資產~~（按揭、抵押或其他債務）~~（例如信用卡應收賬款、汽車貸款、學生貸款、設備租賃、樓宇按揭及樓宇加按貸款）作為抵押的證券。相關按揭、債務的本金利息付款將用以支付證券的本金及利息。*

當利率下降時，此等證券一般會提早清還，因為按揭持有人和其他借款人會將證券相關債務再融資。 當利率上升時，相關債務的借款人不擬為其低息債務再融資。

按揭證券和資產抵押證券的信貸質素相比許多其他類型的債務證券亦較低。*按揭證券及資產抵押證券的價值及質素取決於作為該等證券抵押的貸款、租約或其他應收賬款等相關資產的價值及質素。在發生違責的情況下，按揭證券及資產抵押證券的發行人行使相關資產抵押權益的能力可能有限，所提供以支持證券的信貸提升措施亦可能不足以保障投資者的利益。證券抵押品價值受損（例如未償還貸款）的風險，會導致證券的價值降低。*

按揭證券和資產抵押證券包括兩種類型：機構或非機構。機構按揭證券和資產抵押證券由政府或政府資助的企業所發行，而非機構按揭證券和資產抵押證券則由私營實體所設立。與非機構按揭證券和資產抵押證券相比，機構按揭證券和資產抵押證券的信貸及違約風險通常較低。

按揭證券／資產抵押證券可能高度缺乏流動性而且傾向出現大幅價格波動。與其他債務證券相比，這些工具或會承受較大的信貸、流動性和利率風險。」

(2) 有關子基金對應急可轉換債券的參與投資上限的澄清

目前，子基金的投資政策規定，子基金可投資於吸收虧損工具，例如應急可轉換證券、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。子基金的投資政策將予澄清，以反映其最多可以其資產淨值的5%投資於應急可轉換債券。

子基金的經修訂投資政策將為：

「***投資***

根據披露規例第8條，子基金為倡導ESG特點的金融產品。

*子基金主要（即至少以其資產淨值的80%）投資於在美國境內發行的廣泛系列以美元計值的投資級債券。****投資可包括按揭證券（MBS）及資產抵押證券（ABS）。****子基金可投資於所有類別發行人所發行的債券。子基金亦最多可以其資產淨值的15%投資於在美國境外發行的美元計值債券。*

*子基金最多可以其資產淨值的70%投資於****~~資產抵押證券(ABS)及按揭證券(MBS)~~ 資產抵押證券及按揭證券****。這****包含透過待定（TBA）證券作出的間接參與投資，其以子基金資產淨值的50%為限。對非機構按揭證券和資產抵押證券的參與投資，以子基金資產淨值的50%為限。***

子基金亦可最多以其資產的25%投資於可轉換證券、最多20%投資於低於投資級債券或無評級債券（即本身及其發行人均未獲評級的債券）及最多10%投資於股票。

子基金最多可以其資產的10%投資於UCI及UCITS。

子基金不會以超過其淨資產值的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債務證券。

*子基金可投資於吸收虧損工具，例如應急可轉換債券、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。**子基金最多可以其資產淨值的5%投資於應急可轉換債券**。」*

4. 有關東方匯理系列基金 - 新興市場債券基金及東方匯理系列基金 - 新興市場當地貨幣債券基金（就本節而言統稱為「子基金」）對資產抵押證券及按揭證券的參與投資的澄清

子基金各自的投資政策將予以澄清，以反映子基金各自最多可以其資產淨值的10%投資於資產抵押證券及按揭證券。

5. 根據歐洲議會及理事會2019年11月27日有關成立促進可持續投資框架及修訂披露規例之規例（EU） 2020/852（「分類法規例」）作出加強披露

說明書已作出更新，以反映披露規例及分類法規例下的若干監管披露規定。此等更新並不對任何子基金的投資目標或政策構成變動。

6. 負責任投資政策的澄清

說明書「附錄**V**：可持續投資」所載述的管理公司的負責任投資政策將予以澄清，以反映以下事項：

(1) 對於企業發行人發行的證券，ESG 表現是透過合併說明書「附錄 **V**：可持續投資」所述的三個 ESG 維度將相關證券的平均表現與發行人所處行業的平均表現作出比較，在整體及相關標準的層面上進行評估。

(2) 東方匯理 ESG 評級所採用的方法使用 38 項（而非 37 項）標準，該等標準或者是通用標準（對所有公司通用，無論其業務活動為何），或者是針對特定行業的標準，即會根據行業進行加權，並就彼等對發行人聲譽、營運效率和規例的影響加以考慮。

(3) 為符合投資經理在考慮其子基金的管理程序及監控與特定可持續投資目標相關的限制時設有的任何規定及預期，東方匯理 ESG 評級可能同時以整體層面（針對 三個 E、S 和 G 維度）及個別層面（針對所考慮的 38 項標準中的任何標準）呈示。

7. 各子基金運用衍生工具的資料的更新

說明書中有關各子基金運用衍生工具的資料將予以更新。有關各子基金運用衍生工具的最新披露，請參閱本通知的附錄。

8. 其他更新

說明書亦將作出下列變動：

(1) 更新以反映東方匯理系列基金 - 美元綜合債券基金的基準由「Bloomberg Barclays US Aggregate 指數」易名為「Bloomberg US Aggregate 指數」。

(2) 澄清東方匯理系列基金 - SBI FM 印度股票基金的基準名稱為「MSCI India 10/40 指數」。

(3) 更新本基金的董事會名單。

(4) 更新 Amundi Asset Management 的地址。

(5) 其他澄清及更新。

各項變動的影響

本通知所述有關本基金及各子基金的變動將不會對各子基金的特色及適用於各子基金的風險造成任何重大的影響，且不會導致各子基金的經營及／或管理方式有任何重大變動或對現有投資者造成其他影響。實施變動後，各子基金的收費結構和水平及各子基金的管理成本不會改變。預期該等變動將不會對股東的權利及利益造成重大損害。

倘閣下不同意本通知所詳述對閣下子基金的變動，閣下有權按照現行說明書所訂明的贖回程序和安排贖回閣下的股份，而無須繳付贖回費用。請注意，儘管我們不會就閣下的贖回指示收取任何費用，但閣下的銀行、分銷商或財務顧問、退休金計劃的受託人或管理人可能向閣下收取贖回及／或交易費用，且可能實施不同的交易安排。閣下如有任何疑問，請聯絡閣下的銀行、分銷商或財務顧問、退休金計劃的受託人或管理人。

香港銷售文件已作出或將在適當時候作出修訂（視乎情況而定），以反映上述各項變動。最新的香港銷售文件在本基金的註冊辦事處及香港代表的辦事處（地址為香港金鐘道88號太古廣場第1期901-908室）可供免費索取。最新的香港銷售文件亦可於此網站閱覽：http://www.amundi.com.hk。請注意，此網站未經證監會審核。

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

董事局

謹啟

盧森堡，2022 年 5 月 6 日

附錄 – 基金運用衍生工具的資料

子基金可運用的衍生工具類型

衍生工具是一項價值取決於其中一種參考資產（例如：證券或一籃子證券、指數或利率）的表現之金融合約。每一子基金在時刻貫徹其投資政策的情況下可投資於任何類型的金融衍生工具。就貨幣子基金（此等子基金並不是香港的貨幣市場基金）*而言，請參閱說明書「附錄 IV：與貨幣子基金有關的規則」。此等衍生工具可包括下列組成現時最普遍的衍生工具類型：

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

- 遠期貨幣（包括不可交付的遠期）、貨幣期權、貨幣掉期、股票掉期、期貨合約、利率掉期、通脹掛鈎掉期、利率掉期期權、期貨合約期權、差價合約、波幅期貨、方差掉期、認股權證；
- 總回報掉期（TRS）是一種合約，其中一方將參考資產（包括所有利息、費用收入、市場收益或虧損及信貸損失）的總表現轉移至另一方。子基金的資產對總回報掉期的最高和預期風險承擔在說明書中披露。在若干情況下，此等比例可能更高；
- 信貸衍生工具（例如：信貸違約掉期）是一種當破產、違約或其他「信貸事件」觸發某一方向另一方支付的合約；
- 待定（TBA）衍生工具是通用匯集按揭的遠期合約。此匯集的整體特徵具體指定，但交付予買方的確切證券在交付 2 日前確定，而非在原有交易的時間確定；
- 結構性金融衍生工具，例如：信貸掛鈎及股票掛鈎證券；
- 差價合約是一種價值乃按照兩種參考度量標準（例如：一籃子證券）之間的差額的合約。

期貨一般在交易所買賣。所有其他類型的衍生工具一般在場外交易。就任何指數掛鈎衍生工具而言，指數提供者決定重新調整的頻次。

子基金將能夠在任何指定時間履行其因涉及衍生工具的交易而招致的所有支付和交付義務。

運用衍生工具之目的

子基金（貨幣子基金除外）可按照其投資政策運用衍生工具作對沖不同類型的風險、有效投資組合管理或對若干投資或市場取得參與投資。

貨幣子基金僅可運用衍生工具作對沖相關貨幣子基金其他投資內在的利率或匯率風險。

貨幣對沖　子基金可進行直接對沖（持有與其他投資組合投資所設立持倉相反方向之指定貨幣持倉）及交叉對沖（減低對一種貨幣的有效風險承擔，同時增加對另一貨幣的有效風險承擔）。

貨幣對沖可在子基金層面及在股份類別層面（對於被對沖至與子基金基本貨幣不同貨幣的股份類別）進行。

當子基金持有以多種貨幣計值的資產時，貨幣波動實際上不會被完全對沖的風險會更大。

利率對沖 就利率對沖而言，子基金通常運用利率期貨、利率掉期、出售利率認購期權或購入利率認沽期權。

信貸風險對沖 子基金可運用信貸違約掉期以對沖其資產的信貸風險。這包括對沖特定資產或發行人的風險之對沖，以及對子基金未有直接參與投資的證券或發行的對沖。

期限對沖 尋求減少對沿曲線的利率平行轉移之風險承擔。該對沖可在子基金層面進行。

有效投資組合管理 子基金（貨幣子基金除外）可運用任何可充許衍生工具作有效投資組合管理。有效投資組合管理包括降低成本、現金管理、有序維持流動性和相關實踐（例如：維持 100% 的參與投資，亦同時保留部分流動資產以處理股份贖回及投資的買賣）。有效投資組合管理不包括在整體投資組合層面創造槓桿作用的任何活動。

取得參與投資 子基金（貨幣子基金除外）可運用任何允許衍生工具替代直接投資，以取得任何符合子基金投資目標及政策的任何證券、市場、指數、利率或工具的參與投資。此參與投資可能超過透過直接投資該持倉會取得的參與投資（槓桿效應）。

子基金亦可出售信貸違約掉期作為取得特定信貸參與投資的一個途徑。如掉期所依據的發行人或證券經歷破產、違約或其他「信貸事件」，出售信貸違約掉期可能產生重大損失。

產品資料概要

SBI FM 印度股票基金

（東方匯理系列基金之子基金）

發行人：東方匯理資產管理香港有限公司

2022 年 4 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:	東方匯理資產管理香港有限公司（香港，內部轉授）	
存管處:	CACEIS Bank, Luxembourg Branch	
交易頻密程度:	每日（盧森堡的銀行完整工作天）	
全年經常性開支比率#:	A2 美元 – 累積	2.28%
	A2 美元 – 每年派息	2.28%
基本貨幣:	美元	
派息政策:	派息股份 (D)：若宣佈派息，將支付股息^。後綴為「AD」的股份類別宣派的年度股息（如有）於 9 月支付。 累積股份 (C): 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。後綴為「AD」的股份類別擬從該股份類別應佔的投資淨收益中支付股息（如有）。	
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 2021 年 7 月 1 日至 2021 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）。

目標及投資策略

以達到長期資本增長為目標。

本基金至少以 67%資產投資於其總部或主要業務設於印度的公司的股票及股票掛鈎票據。本基金參照 10/40 MSCI India 指數（「基準」）進行積極管理，並力求取得優越於基準的表現（在扣除適用費用之後）。本基金主要投資於基準的發行人，但基準不用於本基金的投資組合構建，且本基金受全權委託管理，並將投資於未納入基準的發行人。本基金參照基準監控所承擔的風險，但預期會在重大程度上偏離於基準。

投資團隊採用旨在基於增長潛力及估值甄選最具吸引力股票的選股模型（由下而上），管理本基金的投資組合。

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以子基金資產淨值的 50%為限。

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. 集中風險: 本基金集中投資於印度，與較分散投資於不同國家的基金相比，本基金或須承受更高的集中風險。

2. 新興市場風險: 根據本基金的目標及投資策略，本基金將投資於新興市場並可能承受新興市場風險。投資於新興市場發行人之證券涉及特殊考慮因素及風險，包括與新興市場投資相關之風險，如匯率波動、投資於資本市場較小、流動性有限、較高價格波動、交易及控制情況不同且限制外來投資之國家之風險，以及與新興市場的經濟相關之風險，包括高通脹率及利率、大量外債和政治及社會不穩定。

3. 股票風險: 投資於普通股及其他股本證券所承受的市場風險，過往一直帶來較債券及其他定息證券更高的價格波幅。

4. 市場風險: 本基金投資之價值可能由於金融市場之變動而減少。本基金的價值可以極度波動，而且在短期內大幅下跌。閣下的投資價值可能蒙受巨額損失。

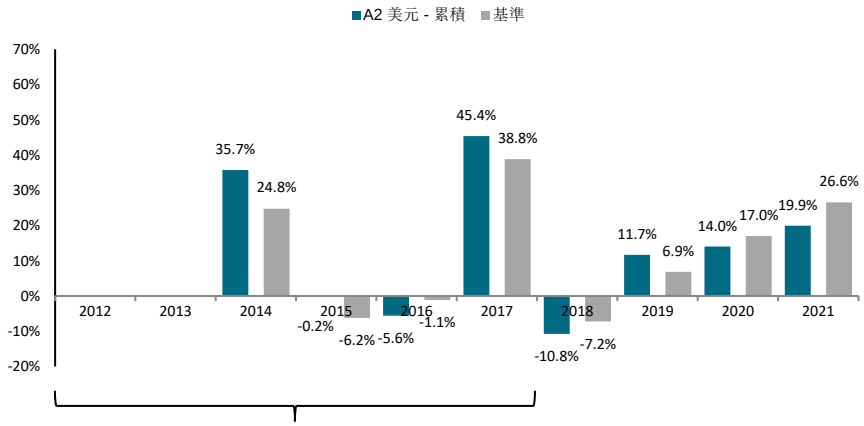
5. 波動風險: 本基金可能承受股票市場之波動風險，因而可能會出現大幅價格變動。視乎其投資目標而定，本基金之表現可能受股市之大幅波動的負面影響。

6. 運用金融衍生工具附帶之風險: 本基金只可為進行對沖而投資於金融衍生工具。投資於金融衍生工具須承受額外風險，包括發行人的信貸風險、流動性風險、對手方風險及估值風險。在不利的市況下，本基金運用金融衍生工具進行對沖未必奏效，本基金或會蒙受巨額損失。

7. 中小型公司之風險: 根據本基金的目標及投資策略，本基金可能投資於中小型公司林立的新興市場。投資於中小型公司之回報率可能較高，但亦可能由於公司倒閉或破產的風險較高及由於中小型公司之股票交易量較少，所以投資於中小型公司之股票在價格上波幅風險較高。

8. 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。

本基金過往的業績表現如何？



從 2017 年 7 月 3 日起，基金的投資目標及政策已作出修改，故就 2017 年 7 月 3 日前的表現而言，其相應情況已不再適用。

- 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 10/40 MSCI India 指數。
- 基金成立日期: 2006 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	現時不多於 1.85%（最高 1.85%）
存管費	包括在行政費用內
表現費	不適用
行政費	現時不多於 0.30%（最高 0.30%）

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滙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（即下一個估值日（定義見說明書）@

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。

- 本基金在每一估值日（定義見說明書）@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其他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*。

@ 盧森堡或印度的主要證券交易所奉行的假期將不視作估值日（定義見說明書）。

*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。