

東方匯理系列基金

(「本公司」)

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

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。

貴股東：

謹此通知，我們對本公司的香港發售文件（包括說明書及產品資料概要）作出了下列變動。除非本通知另行界定，本通知的詞彙和用詞均具有本公司香港發售文件所賦予的相同涵義。

1. 為反映經修訂《單位信託及互惠基金守則》規定所作的修訂

本公司及其若干子基金(均為「子基金」，合稱「各子基金」)獲香港證券及期貨事務監察委員會(「證監會」)認可，因此須遵守證監會頒佈的《單位信託及互惠基金守則》(「基金守則」)的適用規定。《基金守則》已作出修訂。

為了反映經修訂《守則》的適用規定，已對發售文件作出下列主要變動(「基金守則變動」)：

- 有關衍生工具風險承擔淨額的加強披露 – 說明書及各子基金的產品資料概要已作出修訂，以載明有關衍生工具投資的預計最高風險承擔淨額的披露。各子基金的衍生工具風險承擔淨額按證監會頒佈並可不時予以更新的規定及指引計算。

請注意，除下文所列各子基金外，獲認可在香港銷售的各子基金的衍生工具風險承擔淨額，以有關子基金的資產淨值的 50%為限：

- (a) 東方匯理系列基金–環球債券基金–此子基金的衍生工具風險承擔淨額可能超逾其資產淨值的 100%；及
- (b) 東方匯理系列基金–新興市場當地貨幣債券基金–此子基金的衍生工具風險承擔淨額可能超逾其資產淨值的 100%。

就下列各項作出附帶修訂：

- (a) 有關東方匯理系列基金–環球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的管理程序：為了配合加強的披露，剔除風險管理方法及預計最高槓桿比率；及
- (b) 有關說明書附錄 III 標題為「風險計量及管理」一節：以衍生工具風險承擔淨額取代預計最高槓桿比率的提述，及剔除有關各子基金的衍生工具風險承擔淨額以其各自的資產淨值 50%為限的資料。

有關更多詳情，請參閱已更新的說明書。

- 闡明對具有吸收虧損特性的工具(「吸收虧損工具」)的投資額 – 已闡明若干子基金就吸收虧損工具最高投資額的投資政策。

關於各有關子基金對吸收虧損工具最高投資額的資料，請參閱本通知附錄 I。

在說明書標題為「一般投資風險」分節作出附帶修訂，加進了新的風險因素：「與投資於吸收虧損工具有關的風險」並在其中併入現有風險因素「應急可轉換債券(Cocos)風險」。

- 其他修訂 – 為了反映經修訂《基金守則》的規定所作的其他修訂及加強的披露，包括下列各項：
 - (a) 為反映經修訂《基金守則》有關與關連人士的交易及非金錢佣金安排的規定而作出的修訂；
 - (b) 就與本基金及各子基金的資產保管安排有關的重大風險加強披露；
 - (c) 就本基金估值規則的加強披露，包括但不限於進行公平價值調整的相關程序及第三方估值的安排；
及
 - (d) 就處理股東在子基金清盤之下未領款項的安排加強披露。

有關基金守則變動的進一步詳情，請參閱經修訂的香港發售文件。

2. 東方匯理系列基金–歐元貨幣市場基金(本基金在香港不是貨幣市場基金)*及東方匯理系列基金–美元貨幣市場基金(本基金在香港不是貨幣市場基金)*(合稱「各貨幣市場子基金」)根據經修訂《基金守則》的變動

*這是根據歐洲議會及理事會 2017 年 6 月 14 日有關貨幣市場基金的規例(EU) 2017/1131(「貨幣市場基金規例」)之下的標準可變資產淨值貨幣市場基金。

由於經修訂《守則》，只有根據《貨幣市場基金規例》獲歸類為短期貨幣市場基金的基金才可繼續被歸類為經修訂《守則》規定的貨幣市場基金。由於各貨幣市場子基金是根據《貨幣市場基金規例》規定的標準可變資產淨值貨幣市場基金，各貨幣市場子基金未能完全符合經修訂《守則》第 8.2 條的規定，將不再被歸類為經修訂《守則》之下的貨幣市場基金。特別是，各貨幣市場子基金現時維持的投資組合，根據《貨幣市場基金規例》規定，其加權平均屆滿期不超過 90 天，而加權平均有效期不超過 12 個月。因此，各貨幣市場子基金將不能符合經修訂《守則》第 8.2(f)的條文，該條文規定投資組合須維持加權平均屆滿期不超過 60 天，而加權平均有效期不超過 120 天。

從 2019 年 12 月 31 日起，基金說明書將予以修訂，以表明各貨幣市場子基金根據經修訂《守則》並非貨幣市場基金，即使其根據《貨幣市場基金規例》屬標準可變資產淨值貨幣市場基金。各貨幣市場子基金的說

明書及產品資料概要已加進新的風險披露，說明各貨幣市場子基金與根據經修訂《基金守則》第 8.2 條獲認可的貨幣市場基金相比，或須承受更高風險(例如信貸風險及利率風險)。

儘管已重新歸類，為免引起疑問，各貨幣市場子基金的主要特性(包括其投資目標、政策、整體風險概況、收費水平及現行管理方式)並沒有重大變動。

3. 對東方匯理系列基金–中國股票基金投資目標的修訂

從 2020 年 1 月 31 日起，東方匯理系列基金–中國股票基金的投資政策將修訂如下：

「投資

子基金主要 (即至少以淨資產值的 50%) 投資於設於中華人民共和國或在中華人民共和國經營大部分業務的公司所發行並且在中國或香港股票市場上市的股票。本基金可投資於任何一個行業界別或任何具有特定市值的公司的資產淨值比例並不受限制。

子基金可以最多 10% 的資產投資於其他 UCI 及 UCITS。

子基金可以最多 100% 的淨資產投資於中國 B 股。另外，子基金可不時透過互聯互通機制及 / 或授予人民幣合格境外機構投資者的額度投資及直接投資於中國 A 股，投資額以其淨資產的 ~~40%~~**20%** 為限。

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。」

儘管有上述修訂，為免引起疑問，東方匯理系列基金–中國股票基金的主要特性(包括其投資目標、政策、整體風險概況、收費水平及現行管理方式)並沒有重大變動。

4. 對個人資料收集聲明的更新

說明書的個人資料收集聲明已作出更新並通知股東，除東方匯理資產管理香港有限公司外，東方匯理香港信託有限公司亦將可收到及處理股東的個人資料。

有關進一步詳情，請參閱經修訂的說明書。

5. 各項更新

說明書亦已作出下列變動：

- (a) 更新本基金董事名單、管理公司的董事名單及營運人員名單；
- (b) 更新說明書標題為「應急可轉換債券(Cocos)風險」、「基準及子基金表現的風險」及「與從資本支付股息有關的風險」的風險因素，及在標題為「一般投資風險」分節加進新的風險因素「貨幣市場基金風險」；

(c) 更新說明書標題為「自動交換財務賬戶資料」分節；及

(d) 其他附帶修訂及各項更新、草擬及編輯上的修訂。

有關進一步詳情，請參閱經修訂說明書。

本公司的香港發售文件在香港代理人東方匯理資產管理香港有限公司的辦事處（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。本公司的香港說明書亦可在此網址閱覽：<http://www.amundi.com.hk>。請注意，此網址並未經證監會審核。

如就上述事項有任何查詢，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，2019 年 12 月 31 日

附錄 I

有關具有吸收虧損特性的工具最高投資額的資料

下列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、《銀行業（資本）規則》規定的額外一級資本或二級資本等，而這些子基金對該等投資的最高風險承擔限額在下表列明。

各子基金	對吸收虧損工具的最高投資額 (佔資產淨值%)
東方匯理系列基金-環球可轉換債券基金	少於 30%
東方匯理系列基金- 歐元公司債券基金	少於 50%
東方匯理系列基金- 歐元高回報債券基金	少於 30%
東方匯理系列基金- 環球債券基金	少於 30%
東方匯理系列基金-新興市場當地貨幣債券基金	少於 30%
東方匯理系列基金-歐元貨幣市場基金	少於 30%
東方匯理系列基金-美元貨幣市場基金	少於 30%