

## 安聯環球投資基金

可變資本投資公司

註冊辦事處：6 A, route de Trèves, L-2633 Senningerberg

R.C.S. Luxembourg B 71.182

### 股東通告

日期：2023 年 4 月 18 日

**重要提示：**本通告乃重要文件，務請閣下即時垂注。閣下如對本通告的內容有任何疑問，應徵詢獨立專業意見。本公司董事會對本通告內容於刊發當日的準確性承擔全部責任，並於作出一切合理查詢後確認，就其所深知及確信，本通告並無遺漏任何其他事實致使其所載任何陳述有所誤導。除非本通告另有定義，本通告所載詞彙應與本公司日期為 2023 年 2 月的香港基金章程（「香港基金章程」）所述者具有相同涵義。

敬啟者：

安聯環球投資基金（SICAV）（「本公司」）董事會謹此作出以下變動的通知，除另有註明外，以下變動將由 2023 年 5 月 30 日（「生效日期」）起生效：

#### 1. 安聯全方位中國股票基金、安聯中國 A 股機遇基金、安聯神州 A 股基金及安聯中國股票基金（統稱「相關附屬基金」）投資目標及投資限制的變動

|      | 現時                                                                       | 新訂                                                                                                                                                                                                                                                  |
|------|--------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投資目標 | [香港基金章程附錄一乙部有關各自的相關附屬基金的現有披露]                                            | [香港基金章程附錄一乙部有關各自的相關附屬基金的現有披露]，同時透過採取 ESG 評分策略，使本附屬基金的加權平均 ESG 評分優於附屬基金指標的加權平均 ESG 評分。                                                                                                                                                               |
| 投資限制 | <ul style="list-style-type: none"> <li>氣候參與（成效為本）策略（包括排除準則）適用</li> </ul> | <ul style="list-style-type: none"> <li>ESG 評分策略（包括排除準則）適用</li> <li>本附屬基金的投資組合最少 80% 須以 MSCI 的 ESG 評分進行評估。就此而言，投資組合不包括衍生工具及本質上不會獲評估的工具（例如現金及存款）。</li> <li>本附屬基金將根據 ESG 評分策略，透過本附屬基金的加權平均 ESG 評分優於本附屬基金指標的加權平均 ESG 評分（即 ESG 評分較高），以達致投資目標。</li> </ul> |

#### 主要變動概覽

- 為了在投資程序進一步融入環境、社會和管治因素的考慮，相關附屬基金的投資目標及限制將實施以下變動。
- 在重新定位後，除了尋求長期資本增值的現有投資目標外，相關附屬基金將尋求透過採用 ESG 評分策略，在加權平均 ESG 評分方面表現優於各自的指標。優秀表現以相關附屬基金的加權平均 ESG 評分高於各自指標的加權平均 ESG 評分的程度來釐定。
- 採用 ESG 評分策略後，相關附屬基金各自的投資組合最少 80% 須以 MSCI 的 ESG 評分進行評估。投資組合不包括衍生工具及本質上不會獲評估的工具（例如現金及存款）。MSCI 的 ESG 評分衡量發行機構的 ESG 風險承擔，以及與使用以規則為本方法的其他同業比較，發行機構管理該等風險的能力。閣下可瀏覽網站 <https://www.msci.com/our-solutions/esg-investing/esg-ratings>，以參閱 MSCI ESG 評級方法。請注意，此網站未經證監會審閱。

安聯環球投資亞太有限公司

香港

金鐘金鐘道 88 號

太古廣場二座 32 樓

電話 +852 2238 8000

傳真 +852 2877 2566

hk.allianzgi.com

- 適用於 ESG 評分策略的最低排除準則如下：
  - (i) 在圍繞人權、勞工權利、環境及貪腐事宜的做法存在問題，以致嚴重侵犯／違反聯合國全球契約原則、經合組織跨國企業指引及聯合國工商企業與人權指導原則等原則及指引的發行機構所發行的證券；
  - (ii) 業務涉及具爭議性武器（殺傷人員地雷、集束彈藥、化學武器、生物武器、貧鈾、白磷及核武器）的發行機構所發行的證券；
  - (iii) 超過 10% 收益來自武器、軍事設備及軍事服務的發行機構所發行的證券；
  - (iv) 超過 10% 收益來自開採動力煤的發行機構所發行的證券；
  - (v) 超過 20% 收益來自煤炭的公用事業發行機構所發行的證券；及
  - (vi) 業務涉及生產煙草的發行機構所發行的證券；以及超過 5% 收益來自分銷煙草的發行機構所發行的證券。就違反上述第(i)項的發行機構而言，若經過互動協作後發行機構仍不願意作出改變，相關附屬基金將會出售有關發行機構所發行的證券。就違反上述第(ii)至(vi)項的發行機構而言，相關附屬基金將會出售有關發行機構所發行的證券。
- 相關附屬基金在採用 ESG 評分策略後，將不再應用氣候參與（成效為本）策略（包括排除準則）。
- 除上述變動外，相關附屬基金的其他現有投資限制將繼續適用。
- 為免產生疑問，作出上述變動後，相關附屬基金將不會成為符合證監會日期為 2021 年 6 月 29 日的《致證監會認可單位信託及互惠基金的管理公司的通函 - 環境、社會及管治基金》（「ESG 通函」）所載規定的 ESG 基金。

## 對相關附屬基金適用的特點及主要風險之影響

作出上述變動後，預期相關附屬基金的整體風險水平將大致保持不變，而以下額外風險因素將適用於相關附屬基金。

### ESG 評分策略投資風險

- 相關附屬基金採用建基於若干外部 ESG 研究及最低排除準則的 ESG 評分策略，或會對其投資表現構成不利影響，因為執行相關策略可能導致相關附屬基金在有利條件下放棄買入若干證券的機會，及／或在不利條件下出售證券。
- 在評估相關附屬基金投資組合對比其各自指標的 ESG 表現時，相關附屬基金倚賴來自第三方研究數據供應商及內部分析的資料及數據，其可能帶有主觀成份、不完整、不準確或無法取得，因此存在不準確或主觀地評估相關附屬基金相關投資的風險，及因而事實上面對相關附屬基金投資組合可能在 ESG 評分方面表現未能優於其各自指標的風險。此外，ESG 標準缺乏分類。
- 相關附屬基金專注於相關投資的發行機構的 ESG 狀況，與基礎廣泛的基金相比，這或會減低風險分散程度。因此，相比投資策略較多元化的基金，相關附屬基金可能更為波動。此外，相關附屬基金可能特別專注於相關投資的發行機構的 ESG 狀況，而非其財務表現。這可能對相關附屬基金的表現構成不利影響，因而對投資者於相關附屬基金的投資構成不利影響。
- 在進行投資後，相關附屬基金所持有的證券可能出現風格改變，因而不符合相關附屬基金的投資準則。投資經理可能需要在不利條件下出售有關證券，這可導致相關附屬基金的資產淨值下跌。

## 2. 安聯網絡安全基金、安聯日本股票基金及安聯歐元高收益債券基金（統稱「相對關鍵績效指標附屬基金」）投資目標及投資限制的變動

### 安聯網絡安全基金

|      | 現時                                                                       | 新訂                                                                                                                                                                                                               |
|------|--------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投資目標 | 投資於環球股票市場的股票，並專注於業務將受惠於網絡安全或現時與網絡安全有關的公司，以達致長期資本增值。                      | 投資於環球股票市場的股票，並專注於業務將受惠於網絡安全或現時與網絡安全有關的公司，以達致長期資本增值，同時採取可持續發展關鍵績效指標策略（相對）（「關鍵績效指標策略（相對）」），以達致可持續發展關鍵績效指標（定義見下文「投資限制」）。                                                                                            |
| 投資限制 | <ul style="list-style-type: none"> <li>氣候參與（成效為本）策略（包括排除準則）適用</li> </ul> | <ul style="list-style-type: none"> <li>關鍵績效指標策略（相對）（包括排除準則）適用</li> <li>本附屬基金的投資組合最少 80% 須以「加權平均溫室氣體強度（以銷售額計）」進行評估。就此而言，投資組合不包括衍生工具及本質上不會獲評估的工具（例如現金及存款）。</li> <li>可持續發展關鍵績效指標乃投資組合的加權平均溫室氣體強度（以銷售額計）應</li> </ul> |

|  |  |                                                                                              |
|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  | 比同期本附屬基金的指標最少低 <b>20%</b> （即本附屬基金投資組合的加權平均溫室氣體強度（以銷售額計）優於其指標的加權平均溫室氣體強度（以銷售額計））。<br>• 台灣限制適用 |
|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------|

## 安聯日本股票基金

|      | 現時                                                                       | 新訂                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|------|--------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投資目標 | 投資於日本股票市場，以達致長期資本增值。                                                     | 投資於日本股票市場，以達致長期資本增值，同時採取可持續發展關鍵績效指標策略（相對）（「 <b>關鍵績效指標策略（相對）</b> 」），以達致可持續發展關鍵績效指標（定義見下文「投資限制」）。                                                                                                                                                                                                        |
| 投資限制 | <ul style="list-style-type: none"> <li>氣候參與（成效為本）策略（包括排除準則）適用</li> </ul> | <ul style="list-style-type: none"> <li>關鍵績效指標策略（相對）（包括排除準則）適用</li> <li>本附屬基金的投資組合最少 <b>80%</b> 須以「加權平均溫室氣體強度（以銷售額計）」進行評估。就此而言，投資組合不包括衍生工具及本質上不會獲評估的工具（例如現金及存款）。</li> <li>可持續發展關鍵績效指標乃投資組合的加權平均溫室氣體強度（以銷售額計）應比同期本附屬基金的指標最少低 <b>20%</b>（即本附屬基金投資組合的加權平均溫室氣體強度（以銷售額計）優於其指標的加權平均溫室氣體強度（以銷售額計））。</li> </ul> |

## 安聯歐元高收益債券基金

|      | 現時                                                                                                                                       | 新訂                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投資目標 | 投資於以歐元計價的高收益評級債務證券，以達致長期資本增值。                                                                                                            | 投資於以歐元計價的高收益評級債務證券，以達致長期資本增值，同時採取可持續發展關鍵績效指標策略（相對）（「 <b>關鍵績效指標策略（相對）</b> 」），以達致可持續發展關鍵績效指標（定義見下文「投資限制」）。                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 投資限制 | <ul style="list-style-type: none"> <li>氣候參與（成效為本）策略（包括排除準則）適用</li> <li>指標：美國洲際交易所美銀美林歐元高收益 <b>BB-B</b> 級限制指數。自由度：顯著。預期重疊程度：重大</li> </ul> | <ul style="list-style-type: none"> <li>關鍵績效指標策略（相對）（包括排除準則）適用</li> <li>本附屬基金的投資組合最少 <b>70%</b> 須以「加權平均溫室氣體強度（以銷售額計）」進行評估。就此而言，投資組合不包括衍生工具及本質上不會獲評估的工具（例如現金及存款）。</li> <li>可持續發展關鍵績效指標乃投資組合的加權平均溫室氣體強度（以銷售額計）應比同期本附屬基金的指標最少低 <b>20%</b>（即本附屬基金投資組合的加權平均溫室氣體強度（以銷售額計）優於其指標的加權平均溫室氣體強度（以銷售額計））。</li> <li>指標：美國洲際交易所美銀美林歐元高收益 <b>BB-B</b> 級限制指數（美國洲際交易所指數將交易成本納入計算）。自由度：顯著。預期重疊程度：重大</li> </ul> |

## 相對關鍵績效指標附屬基金的主要變動概覽

- 我們對本公司的基金系列進行定期審閱，以確保隨著投資市場變化，該等基金仍然符合投資者需要。在作出定期審閱後，我們將會對相對關鍵績效指標附屬基金的投資目標及限制作出以下變動，作為相對關鍵績效指標附屬基金重新定位及修訂工作的一部份。
- 相對關鍵績效指標附屬基金將進行重新定位，以成為符合 **ESG** 通函所載規定的 **ESG** 基金。
- 在重新定位後，除了透過投資於相關市場（如適用）以達致長期資本增值的現有投資目標外，相對關鍵績效指標附屬基金亦將採取可持續發展關鍵績效指標策略（相對）（「**關鍵績效指標策略（相對）**」），尋求各自投資組合的被投資公司的加權平均年度溫室氣體排放量強度（以年度銷售額計）比各自指標最少低 **20%**（「**可持續發展關鍵績效指標**」），從而取得優於各自指標的表現。
- 採取關鍵績效指標策略（相對）後，投資組合的最低比例（安聯歐元高收益債券基金為 **70%**，其餘相對關鍵績效指標附屬基金為 **80%**）須以「加權平均溫室氣體強度（以銷售額計）」進行評估。投資組合不包括衍生工具及本質上不會獲評估的工具（例如現金及存款）。溫室氣體強度即發行機構的年度溫室氣體排放量。銷售額即發行機構的年度銷售額。發行機構的溫室氣體強度（以銷售額計）為發行機構的年度溫室氣體排放量（以每百萬年度銷售額的公噸二氧化碳當量(**tCO<sub>2</sub>e**)計）。按銷售額正常化的溫室氣體比率有助比較不同規模的發行機構。加權平均溫室氣體強度（以銷售額計）是構成投資組合的證券發行機構按其在投資組合中的相對權重調整後的加權平均溫室氣體強度（以銷售額計）。這意味證券發行機構的溫室氣體強度（以銷售額計）為投資程序的一項主要考慮。在建構投資組合時，投資經理將更有可能挑選更具高效溫室氣體的發行機構（以發行機構銷售額計），從而使相對關鍵績效指標附屬基金能夠達致上文所述各自的可持續發展關鍵績效指標。第三方數據將用於釐定發行機構的溫室氣體強度（以銷售額計）。
- 相對關鍵績效指標附屬基金在採用關鍵績效指標策略（相對）後，將不再應用氣候參與（成效為本）策略（包括排除準則）。

- 除上述變動外，相對關鍵績效指標附屬基金的其他現有投資政策及限制將繼續適用。
- 適用於關鍵績效指標策略（相對）的最低排除準則如下：
  - 在圍繞人權、勞工權利、環境及貪腐事宜的做法存在問題，以致嚴重侵犯／違反聯合國全球契約原則、經合組織跨國企業指引及聯合國工商企業與人權指導原則等原則及指引的發行機構所發行的證券；
  - 業務涉及具爭議性武器（殺傷人員地雷、集束彈藥、化學武器、生物武器、貧鈾、白磷及核武器）的發行機構所發行的證券；
  - 超過 10% 收益來自武器、軍事設備及軍事服務的發行機構所發行的證券；
  - 超過 10% 收益來自開採動力煤的發行機構所發行的證券；
  - 超過 20% 收益來自煤炭的公用事業發行機構所發行的證券；及
  - 業務涉及生產煙草的發行機構所發行的證券；以及超過 5% 收益來自分銷煙草的發行機構所發行的證券。就違反上述第(i)項的發行機構而言，若經過互動協作後發行機構仍不願意作出改變，相對關鍵績效指標附屬基金將會出售有關發行機構所發行的證券。就違反上述第(ii)至(vi)項的發行機構而言，相對關鍵績效指標附屬基金將會出售有關發行機構所發行的證券。

### 對相對關鍵績效指標附屬基金適用的特點及主要風險之影響

作出上述變動後，預期相對關鍵績效指標附屬基金的整體風險水平將大致保持不變，而以下額外主要風險因素將適用於相對關鍵績效指標附屬基金：

#### 可持續發展關鍵績效指標策略（相對）投資風險

- 相對關鍵績效指標附屬基金採用加權平均溫室氣體強度（以銷售額計）分析、外部 ESG 研究及最低排除準則，或會對其投資表現構成不利影響，因為執行相關策略可能導致相對關鍵績效指標附屬基金在有利條件下放棄買入若干證券的機會，及／或在不利條件下出售證券。
- 在評估相對關鍵績效指標附屬基金是否達致可持續發展關鍵績效指標時，相對關鍵績效指標附屬基金倚賴來自第三方研究數據供應商及內部分析的資料及數據，其可能帶有主觀成份、不完整、不準確或無法取得，因此存在不正確或主觀評估相對關鍵績效指標附屬基金相關投資的風險，故面對相對關鍵績效指標附屬基金未能達致可持續發展關鍵績效指標之風險。
- 相對關鍵績效指標附屬基金專注於建基於溫室氣體強度（以銷售額計）的可持續發展關鍵績效指標，與基礎廣泛的基金相比，這或會減低風險分散程度。因此，相比投資策略較多元化的基金，相對關鍵績效指標附屬基金可能更為波動。此外，相對關鍵績效指標附屬基金可能特別專注於被投資公司的溫室氣體效率，而非其財務表現。這可能對相對關鍵績效指標附屬基金的表現構成不利影響，因而對投資者於相對關鍵績效指標附屬基金的投資構成不利影響。
- 在進行投資後，相對關鍵績效指標附屬基金所持有的證券可能出現風格改變，因而不符合相對關鍵績效指標附屬基金的投資準則。投資經理可能需要在不利條件下出售有關證券，這可導致相對關鍵績效指標附屬基金的資產淨值下跌。

### 3. 安聯環球浮動息率基金（「SRI 附屬基金」）投資目標及投資限制的變動

|      | 現時                                                                                                                      | 新訂                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投資目標 | 本附屬基金旨在透過環球範疇的浮息票據賺取收益。本附屬基金尋求長遠資本增值潛力。                                                                                 | 本附屬基金旨在透過環球範疇的浮息票據賺取收益，並根據可持續及責任投資策略（SRI 策略），尋求長遠資本增值潛力。                                                                                                                                                                                                                |
| 投資限制 | <ul style="list-style-type: none"> <li>本附屬基金最多可將50%的資產投資於高收益投資類別<sup>1</sup></li> <li>氣候參與（成效為本）策略（包括排除準則）適用</li> </ul> | <ul style="list-style-type: none"> <li>SRI 策略（包括排除準則）適用</li> <li>本附屬基金的投資組合最少80%須以SRI評級方式進行評估。就此而言，投資組合不包括未獲評級的衍生工具及本質上不會獲評級的工具（例如現金及存款）。</li> <li>根據SRI評級，SRI評級分數為0至1（評級範圍介乎0至4；4為最高評分）的發行機構被視為不可投資（即會被排除在外）</li> <li>本附屬基金最多可將30%的資產投資於高收益投資類別<sup>1</sup></li> </ul> |

### SRI 附屬基金的主要變動概覽

- 為了在投資程序進一步融入環境、社會、人權、管治和商業行為因素的考慮，SRI 附屬基金的投資目標及限制將實施以下變動。
- 在重新定位後，除未獲評級的衍生工具及本質上不會獲評級的工具（例如現金及存款）外，SRI 附屬基金最少將 80% 的資產根據 SRI 策略進行投資。有關 SRI 策略的詳細描述，請參閱本通告附錄一。

- 在 SRI 評級下，發行機構將接受以 SRI 研究為基礎的內部評級評估，以及根據基於以下準則進行的分析獲授予 0 至 4 的評分（4 為最高評分）：考慮發行機構的人權、社會、環境、商業行為和管治等領域。SRI 評級為 0 及 1 的發行機構將會被排除在 SRI 附屬基金投資範疇以外。
- 適用於 SRI 策略的最低排除準則如下：
  - (i) 在圍繞人權、勞工權利、環境及貪腐事宜的做法存在問題，以致嚴重侵犯／違反聯合國全球契約原則、經合組織跨國企業指引及聯合國工商企業與人權指導原則等原則及指引的發行機構所發行的證券；
  - (ii) 業務涉及具爭議性武器（殺傷人員地雷、集束彈藥、化學武器、生物武器、貧鈾、白磷及核武器）的發行機構所發行的證券；
  - (iii) 超過 10% 收益來自武器、軍事設備及軍事服務的發行機構所發行的證券；
  - (iv) 超過 10% 收益來自開採動力煤的發行機構所發行的證券；
  - (v) 超過 20% 收益來自煤炭的公用事業發行機構所發行的證券；
  - (vi) 業務涉及生產煙草的發行機構所發行的證券；以及超過 5% 收益來自分銷煙草的發行機構所發行的證券；及
  - (vii) 自由之家指數評分不足的主權發行機構所發行的證券（除非 SRI 附屬基金的個別投資限制另有說明）。自由之家指數是由美國研究機構自由之家編製，有關指數量度不同國家的政治權利及公民自由，並根據有關民主表現及政府運作的一系列準則對國家進行評估。就違反上述第(i)項的發行機構而言，若經過互動協作後發行機構仍不願意作出改變，SRI 附屬基金將會出售有關發行機構所發行的證券。就違反上述第(ii)至(vii)項的發行機構而言，SRI 附屬基金將會出售有關發行機構所發行的證券。
- SRI 附屬基金在採用 SRI 策略後，將不再應用氣候參與（成效為本）策略（包括排除準則）。
- 在重新定位後，SRI 附屬基金於高收益投資類別 1 的最高限制將由 SRI 附屬基金資產的 50% 降至 30%。
- 除上述變動外，SRI 附屬基金的其他現有投資限制將繼續適用。
- 為免產生疑問，在重新定位後，SRI 附屬基金將不會成為符合 ESG 通函所載規定的 ESG 基金。

#### 對 SRI 附屬基金適用的特點及主要風險之影響

作出上述變動後，預期 SRI 附屬基金的整體風險水平將會下降，原因是 SRI 附屬基金於高收益投資類別 1 的投資減少。以下額外主要風險因素將適用於 SRI 附屬基金：

##### SRI 策略投資風險

- SRI 附屬基金採用若干（內部／外部）ESG 評級評估及／或最低排除準則，或會對 SRI 附屬基金的投資表現構成不利影響，因為執行 SRI 策略可能導致 SRI 附屬基金在有利條件下放棄買入若干證券的機會，及／或在不利條件下出售證券。
- 在根據 ESG 研究評估一家發行機構的資格時，SRI 附屬基金倚賴來自第三方 ESG 研究數據供應商及內部分析的資料及數據，其可能帶有主觀成份、不完整、不準確或無法取得，因此存在不準確或主觀地評估證券或發行機構的風險，或面對 SRI 附屬基金可能投資於不符合相關準則的發行機構之風險。此外，SRI 缺乏標準化的分類。
- SRI 附屬基金將重點放在 SRI，或會降低風險分散程度，故 SRI 附屬基金可能特別受此等投資的發展影響。因此，相比投資策略較多元化的基金，SRI 附屬基金可能更為波動。SRI 附屬基金的價值可能因此等投資的不利狀況影響而更為波動。這可能對 SRI 附屬基金的表現構成不利影響，因而對投資者於 SRI 附屬基金的投資構成不利影響。
- 在 SRI 附屬基金進行投資後，SRI 附屬基金所持有的證券可能出現風格改變，因而不符合 SRI 附屬基金的投資準則。投資經理可能需要在不利條件下出售有關證券，這可導致 SRI 附屬基金的資產淨值下跌。

#### 4. 安聯美國短存續期高收益債券基金（「絕對關鍵績效指標附屬基金」）投資目標及投資限制的變動

|      | 現時                                                                       | 新訂                                                                                                                                                                  |
|------|--------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投資目標 | 投資於美國債券市場的短存續期高收益評級企業債券，以達致長期收益及降低波幅。                                    | 投資於美國債券市場的短存續期高收益評級企業債券，以達致長期收益及降低波幅，同時採取可持續發展關鍵績效指標策略（絕對）（「關鍵績效指標策略（絕對）」），以達致可持續發展關鍵績效指標（定義見下文「投資限制」）。                                                             |
| 投資限制 | <ul style="list-style-type: none"> <li>氣候參與（成效為本）策略（包括排除準則）適用</li> </ul> | <ul style="list-style-type: none"> <li>關鍵績效指標策略（絕對）（包括排除準則）適用</li> <li>本附屬基金的投資組合最少 70% 須以「加權平均溫室氣體強度（以銷售額計）」進行評估。就此而言，投資組合不包括衍生工具及本質上不會獲評估的工具（例如現金及存款）。</li> </ul> |

|  |                                                                                                                                                                           |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <ul style="list-style-type: none"> <li>• 可持續發展關鍵績效指標乃自參考日期（即採用關鍵績效指標策略（絕對）的首日）開始的改善路徑上的加權平均溫室氣體強度（以銷售額計）按年減少最少 5%。自參考日期至策略採用的首個財政年度結束期間，可持續發展關鍵績效指標的按比例臨時比率適用。</li> </ul> |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## 主要變動概覽

- 我們對本公司的基金系列進行定期審閱，以確保隨著投資市場變化，該等基金仍然符合投資者需要。在作出定期審閱後，我們將會對絕對關鍵績效指標附屬基金的投資目標及限制作出以下變動，以作為絕對關鍵績效指標附屬基金重新定位及修訂工作的一部份。
- 在重新定位後，除了投資於美國債券市場的短存續期高收益評級企業債券，以達致長期收益及降低波幅的現有投資目標外，絕對關鍵績效指標附屬基金亦將採取可持續發展關鍵績效指標策略（絕對）（「**關鍵績效指標策略（絕對）**」），尋求投資組合的被投資公司在改善路徑上的加權平均年度溫室氣體排放量強度（以年度銷售額計）按年減少最少 5%（「**可持續發展關鍵績效指標**」）。
- 採取關鍵績效指標策略（絕對）後，絕對關鍵績效指標附屬基金的投資組合最少 70%須以「加權平均溫室氣體強度（以銷售額計）」進行評估。投資組合不包括衍生工具及本質上不會獲評估的工具（例如現金及存款）。溫室氣體強度即發行機構的年度溫室氣體排放量。銷售額即發行機構的年度銷售額。發行機構的溫室氣體強度（以銷售額計）為發行機構的年度溫室氣體排放量（以每百萬年度銷售額的公噸二氧化碳當量(tCO<sub>2</sub>e)計）。按銷售額正常化的溫室氣體比率有助比較不同規模的發行機構。加權平均溫室氣體強度（以銷售額計）是構成絕對關鍵績效指標附屬基金投資組合的證券發行機構按其投資組合中的相對權重調整後的加權平均溫室氣體強度（以銷售額計）。在建構投資組合時，投資經理將更有可能挑選更具高效溫室氣體的發行機構（以發行機構銷售額計），從而使絕對關鍵績效指標附屬基金能夠達致上文所述的可持續發展關鍵績效指標。第三方數據將用於釐定發行機構的溫室氣體強度（以銷售額計）。投資經理將進行年度檢查，以確保絕對關鍵績效指標附屬基金的加權平均溫室氣體強度（以銷售額計）的實際降幅將最少達到按時間序列計算的可持續發展關鍵績效指標。時間序列將在採用關鍵績效指標策略（絕對）的首日（「**參考日期**」）確立。截至時間序列的各財政年度結束時，量度絕對關鍵績效指標附屬基金投資組合的加權平均溫室氣體強度（以銷售額計）自上一個財政年度結束以來的降幅，以確定是否已達致可持續發展關鍵績效指標。自參考日期至關鍵績效指標策略（絕對）採用的首個財政年度結束期間，可持續發展關鍵績效指標的按比例臨時比率適用。
- 適用於關鍵績效指標策略（絕對）的最低排除準則如下：
  - (i) 在圍繞人權、勞工權利、環境及貪腐事宜的做法存在問題，以致嚴重侵犯／違反聯合國全球契約原則、經合組織跨國企業指引及聯合國工商企業與人權指導原則等原則及指引的發行機構所發行的證券；
  - (ii) 業務涉及具爭議性武器（殺傷人員地雷、集束彈藥、化學武器、生物武器、貧鈾、白磷及核武器）的發行機構所發行的證券；
  - (iii) 超過 10%收益來自武器、軍事設備及軍事服務的發行機構所發行的證券；
  - (iv) 超過 10%收益來自開採動力煤的發行機構所發行的證券；
  - (v) 超過 20%收益來自煤炭的公用事業發行機構所發行的證券；及
  - (vi) 業務涉及生產煙草的發行機構所發行的證券；以及超過 5%收益來自分銷煙草的發行機構所發行的證券。就違反上述第(i)項的發行機構而言，若經過互動協作後發行機構仍不願意作出改變，絕對關鍵績效指標附屬基金將會出售有關發行機構所發行的證券。就違反上述第(ii)至(vi)項的發行機構而言，絕對關鍵績效指標附屬基金將會出售有關發行機構所發行的證券。
- 絕對關鍵績效指標附屬基金在採用關鍵績效指標策略（絕對）後，將不再應用氣候參與（成效為本）策略（包括排除準則）。
- 除上述變動外，絕對關鍵績效指標附屬基金的其他現有投資限制將繼續適用。
- 為免產生疑問，絕對關鍵績效指標附屬基金將不會成為符合 ESG 通函所載規定的 ESG 基金。

## 對絕對關鍵績效指標附屬基金適用的特點及主要風險之影響

作出上述變動後，預期絕對關鍵績效指標附屬基金的整體風險水平將大致保持不變，而以下額外主要風險因素將適用於絕對關鍵績效指標附屬基金：

#### 可持續發展關鍵績效指標策略（絕對）投資風險

- 絕對關鍵績效指標附屬基金採用加權平均溫室氣體強度（以銷售額計）分析、外部 ESG 研究及最低排除準則，或會對其投資表現構成不利影響，因為執行相關策略可能導致絕對關鍵績效指標附屬基金在有利條件下放棄買入若干證券的機會，及／或在不利條件下出售證券。在評估絕對關鍵績效指標附屬基金是否達致可持續發展關鍵績效指標時，絕對關鍵績效指標附屬基金倚賴來自第三方研究數據供應商及內部分析的資料及數據，其可能帶有主觀成份、不完整、不準確或無法取得，因此存在不正確或主觀評估絕對關鍵績效指標附屬基金相關投資的風險，故面對絕對關鍵績效指標附屬基金未能達致可持續發展關鍵績效指標之風險。
- 絕對關鍵績效指標附屬基金專注於建基於溫室氣體強度（以銷售額計）的可持續發展關鍵績效指標。與基礎廣泛的基金相比，這或會減低風險分散程度。因此，相比投資策略較多元化的基金，絕對關鍵績效指標附屬基金可能更為波動。此外，絕對關鍵績效指標附屬基金可能特別專注於被投資公司的溫室氣體效率，而非其財務表現。這可能對絕對關鍵績效指標附屬基金的表現構成不利影響，因而對投資者於絕對關鍵績效指標附屬基金的投資構成不利影響。在進行投資後，絕對關鍵績效指標附屬基金所持有的證券可能出現風格改變，因而不符合絕對關鍵績效指標附屬基金的投資準則。投資經理可能需要在不利條件下出售有關證券，這可導致絕對關鍵績效指標附屬基金的資產淨值下跌。

#### 5. 若干附屬基金的投資管理安排變動

##### (a) 現時由 Allianz Global Investors GmbH（管理公司）透過英國分行管理的附屬基金的投資管理安排變動

現時，Allianz Global Investors GmbH（「**AllianzGI** – 德國」）（管理公司）與其英國分行共同管理數項附屬基金，而若干附屬基金由英國分行單獨管理。

鑑於英國脫離歐盟，因此有必要調整管理公司在英國業務的法律架構。為了在英國脫歐後繼續提供投資管理服務，必須將管理公司的英國分行（「**AllianzGI** – 英國分行」）轉移至一個獲英國金融行為監管局認可及受其監管的新英國法律實體 Allianz Global Investors UK Limited（「**AllianzGI** UK」）。因此，下表所列附屬基金的投資轉授將作出以下變動。

值得注意的是，代理投資團隊完全有能力管理各自的投資策略，不論是透過該等投資團隊現有投資組合經理的專業知識，抑或是透過將 AllianzGI - 英國分行現時僱用的代理投資組合經理調遷至 AllianzGI UK。主要投資團隊從 AllianzGI - 英國分行轉至 AllianzGI UK 後，可確保各受影響附屬基金的投資策略得以持續實施。此外，相關附屬基金仍受管理公司的法律、合規及風險監控所規管。向附屬基金收取的費用及開支將保持不變，不受委任 AllianzGI UK 作為投資經理所影響。

管理公司、AllianzGI – 德國、AllianzGI UK 及相關附屬基金的所有現有投資經理均為安聯集團旗下的公司。

| 附屬基金名稱            | 現時                                                    | 新訂                                                |
|-------------------|-------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|
|                   | 1) 進行投資管理職能的管理公司<br>分行及／或<br>2) 投資經理（或副投資經理，如有指定）     | 1) 進行投資管理職能的管理公司<br>分行及／或<br>2) 投資經理（或副投資經理，如有指定） |
| 安聯潔淨地球基金          | 1) AllianzGI – 德國及AllianzGI – 英國分行<br>2) AllianzGI AP | 1) AllianzGI – 德國<br>2) AllianzGI AP              |
| 安聯新興市場精選債券基金      | 1) AllianzGI – 德國及AllianzGI – 英國分行<br>2) AllianzGI AP | 2) AllianzGI UK及AllianzGI AP                      |
| 安聯新興市場 SRI 債券基金   | 1) AllianzGI – 德國及AllianzGI – 英國分行<br>2) AllianzGI AP | 2) AllianzGI UK                                   |
| 安聯新興市場 SRI 企業債券基金 | 1) AllianzGI – 德國及AllianzGI – 英國分行<br>2) AllianzGI AP | 2) AllianzGI UK及AllianzGI AP                      |

|                 |                                                                                            |                                                                                                      |
|-----------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 安聯歐洲成長基金        | 1) AllianzGI – 德國及AllianzGI – 英國分行                                                         | 1) AllianzGI – 德國<br>2) AllianzGI UK                                                                 |
| 安聯糧食安全基金        | 1) AllianzGI – 德國及AllianzGI – 英國分行                                                         | 2) AllianzGI UK                                                                                      |
| 安聯環球浮動息率基金      | 1) AllianzGI – 德國及AllianzGI – 英國分行                                                         | 1) AllianzGI – 德國<br>2) AllianzGI UK                                                                 |
| 安聯環球高收益基金       | 1) AllianzGI – 英國分行                                                                        | 2) AllianzGI UK                                                                                      |
| 安聯環球可持續多元資產均衡基金 | 1) AllianzGI – 德國及AllianzGI – 英國分行<br>2) AllianzGI AP、AllianzGI Japan 及AllianzGI Singapore | 1) AllianzGI – 德國<br>2) AllianzGI UK、AllianzGI AP、AllianzGI Japan 及AllianzGI Singapore               |
| 安聯環球機遇債券基金      | 1) AllianzGI – 英國分行                                                                        | 2) AllianzGI UK                                                                                      |
| 安聯全球小型股票基金      | 1) AllianzGI – 德國及AllianzGI – 英國分行<br>2) AllianzGI AP及AllianzGI Japan，各以副投資經理身份行事          | 1) AllianzGI – 德國<br>2) AllianzGI UK（以投資經理身份行事）、AllianzGI AP（以副投資經理身份行事）及AllianzGI Japan（以副投資經理身份行事） |
| 安聯全球永續發展基金      | 1) AllianzGI – 德國及AllianzGI – 英國分行                                                         | 1) AllianzGI – 德國<br>2) AllianzGI UK                                                                 |
| 安聯綠色債券基金        | 1) AllianzGI – 法國分行                                                                        | 1) AllianzGI – 德國及AllianzGI – 法國分行<br>2) AllianzGI UK                                                |
| 安聯變革世界基金        | 1) AllianzGI – 德國及AllianzGI – 英國分行                                                         | 2) AllianzGI UK                                                                                      |

列表說明：

若管理公司內部進行其投資管理職能（即在此情況下並無投資經理），則管理公司相應分行的名稱將於上表 1) 進行投資管理職能的管理公司分行中披露。

若管理公司將投資管理職能轉授一名或多名投資經理，及（如適用）相應投資經理將其部份職能再轉授一名或多名副投資經理，則相應投資經理及／或副投資經理的名稱將於上表 2) 投資經理（或副投資經理，如有指定）中披露。

若管理公司將其部份投資管理職能轉授一名或多名投資經理，則管理公司相應分行的名稱將於上表 1) 進行投資管理職能的管理公司分行中披露，而投資經理將於上表 2) 投資經理（或副投資經理，如有指定）中披露。

下文概述上表所列相關附屬基金的投資轉授安排變動：

- AllianzGI – 英國分行不再管理安聯潔淨地球基金，但管理公司將繼續與現有投資經理共同管理此附屬基金。
- 就安聯歐洲成長基金、安聯環球浮動息率基金、安聯環球高收益基金、安聯環球可持續多元資產均衡基金、安聯環球機遇債券基金、安聯全球小型股票基金及安聯全球永續發展基金而言，AllianzGI – 英國分行將不再管理該等附屬基金，而 AllianzGI UK 將獲委任以投資經理的身份（如適用）與現時管理該等附屬基金的 AllianzGI – 德國及／或其他投資經理／副投資經理（視情況而定）共同管理該等附屬基金。



- 就安聯新興市場精選債券基金、安聯新興市場 SRI 債券基金、安聯新興市場 SRI 企業債券基金、安聯糧食安全基金及安聯變革世界基金而言，AllianzGI UK 將獲委任以投資經理的身份管理該等附屬基金。此外，AllianzGI — 德國及 AllianzGI — 英國分行將不再履行有關該等附屬基金的投資管理職能。安聯新興市場 SRI 債券基金的現有投資經理 AllianzGI AP 將不再管理安聯新興市場 SRI 債券基金，但將繼續以投資經理的身份管理安聯新興市場精選債券基金及安聯新興市場 SRI 企業債券基金。
- 就安聯綠色債券基金而言，AllianzGI UK 將與現時管理此附屬基金的 AllianzGI — 法國分行共同獲委任為此附屬基金的投資經理。AllianzGI — 德國亦將同時開始進行此附屬基金的投資管理職能。

(b) 安聯人民幣債券基金增設投資經理

鑑於安聯集團進行內部資源重組，AllianzGI AP 將獲委任為安聯人民幣債券基金的新投資經理。AllianzGI AP 將與現有投資經理 AllianzGI Singapore 共同管理此附屬基金。管理公司、AllianzGI AP 及 AllianzGI Singapore 均為安聯集團旗下的公司。

## 6. 若干附屬基金的其他雜項變動

| 附屬基金名稱                  | 理由／動機<br>其他資料                      | 投資目標或限制的變動<br>(香港基金章程附錄一乙部)          |                                                              |
|-------------------------|------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------------------------------|
|                         |                                    | 現時                                   | 新訂                                                           |
| 安聯綠色債券基金                | 澄清與新興市場投資有關的投資限制，以妥善反映適用的投資策略。     | - 本附屬基金可將資產投資於新興市場                   | - 本附屬基金最多可將 30% 的資產投資於新興市場                                   |
| 安聯新興亞洲股票基金              | 修訂投資目標及限制，以澄清投資範疇。                 | 投資於發展中亞洲股票市場（日本、香港及新加坡除外），以達致長期資本增值。 | 投資於亞洲新興市場（日本、香港及新加坡除外）及／或 MSCI 新興亞洲新領域市場指數成份國家的股票，以達致長期資本增值。 |
|                         |                                    | - 本附屬基金可將資產投資於新興市場                   | - 本附屬基金可將資產投資於亞洲新興市場或 MSCI 新興亞洲新領域市場指數的成份國家                  |
| 安聯環球金屬及礦業基金<br>安聯環保能源基金 | 由於附屬基金擬在台灣分銷，因此增加台灣限制。             | 該限制此前不適用。                            | - 台灣限制適用                                                     |
| 安聯環球機遇債券基金              | 澄清與高收益投資類別 1 有關的投資限制，以妥善反映適用的投資策略。 | - 本附屬基金最多可將 40% 的資產投資於高收益投資類別 1      | - 本附屬基金最多可將 30% 的資產投資於高收益投資類別 1                              |

為免產生疑問，上表列示的相關雜項變動僅為澄清修訂，相關附屬基金現時實際採用的投資目標或限制並無任何實際或重大變動。

## 7. 若干附屬基金符合分類的投資最低百分比更新

歐洲議會及理事會於 2020 年 6 月 18 日就成立促進可持續投資的框架而發出的規例(EU) 2020/852（「分類規例」）第 8 條要求披露資料，說明其活動如何及在多大程度上與符合分類規例規定的環境可持續經濟活動相關。

董事會謹此通知，已核查香港基金章程附錄七所披露的附屬基金最低符合分類的投資，並將在適當情況下作出調整以反映當前環境。因此，以下附屬基金概述的百分比已設定為 0.01%：

- 安聯新興市場 SRI 債券基金
- 安聯新興市場 SRI 企業債券基金
- 安聯歐元高收益債券基金
- 安聯歐洲股息基金
- 安聯亞洲靈活債券基金
- 安聯環球浮動息率基金
- 安聯環球高收益基金
- 安聯環球可持續多元資產均衡基金
- 安聯全球永續發展基金
- 安聯綠色債券基金
- 安聯變革世界基金

-----

除本通告另有披露外，本通告中詳述的變動將不會 (i) 對附屬基金適用的特點及風險構成重大轉變；(ii) 導致附屬基金的營運及／或管理方式出現其他轉變；或(iii)對現有股東的權利或利益造成重大損害。落實本通告所載變動後，附屬基金的費用結構、費用及開支，以及管理附屬基金的成本亦不會出現任何轉變。本通告中詳述的變動所招致的成本及／或開支將由管理公司承擔。

若股東並不同意上述變動，可於 2023 年 5 月 29 日下午 5 時正（香港時間）或之前向香港代表提出要求，按照香港基金章程所述程序贖回或轉換其股份，贖回或轉換費用全免。請注意，閣下的分銷商或同類代理人可能就收取交易要求而設定不同截止日期。此外，閣下的分銷商或同類代理人或會向閣下收取交易費用。閣下如有任何疑問，請聯絡閣下的分銷商或同類代理人。

香港銷售文件（包括香港基金章程及受影響附屬基金的產品資料概要）將作出更新，以在適當時候反映上述變動、其他雜項及澄清修訂。已更新的香港銷售文件將在適當時候由香港代表提供免費索閱及上載於網站（[hk.allianzgi.com](http://hk.allianzgi.com)）。請注意，香港基金章程將不再附有詳細說明 SFDR 規定的披露內容的合約前範本（「合約前範本」），以配合網站提供相關披露的安排。合約前範本可於網站 <https://regulatory.allianzgi.com> 查閱。請注意，上述網站未經證監會審閱及可能含有未經證監會認可的附屬基金資料。

閣下如對本通告內容或閣下的投資有任何疑問，請徵詢閣下的理財顧問意見或閣下可聯絡香港代表（地址為香港金鐘金鐘道88號太古廣場二座32樓，電話：+852 2238 8000及傳真：+852 2877 2566）。

此致

列位股東 台照

承董事會命  
安聯環球投資基金

## 附錄一 — SRI策略的說明

SRI策略考慮以聯合國全球契約原則為基礎的可持續發展因素，並符合「可持續及責任投資」原則。關於責任的部份包括互動協作及代理投票。關於可持續的部份包括以下各方面：

- (i) 環境特點—根據發行機構的環境管理評估證券。
- (ii) 社會特點—根據發行機構的社會責任評估證券。
- (iii) 人權特點—根據發行機構在商業行為上對人權的尊重評估證券。
- (iv) 管治特點—根據指導及控制發行機構的規則、慣例和流程系統評估證券。
- (v) 商業行為—根據發行機構的業務交易關係及其產品安全性評估證券（此領域不適用於由主權實體發行的證券）。

投資經理會對上述環境、社會、人權、管治及商業行為領域進行分析，以評估發行機構的策略如何考慮可持續發展及長期議題。

此外，上述領域（包括任何子類別）是由投資經理設定，並界定SRI附屬基金的投資範圍，以符合實施SRI策略的框架。SRI策略將透過排除SRI評級低於或納入SRI評級高於管理公司不時釐定的指定水平之發行機構，根據SRI評級對SRI附屬基金的投資範疇進行負面或正面的篩選。SRI評級是一項以SRI研究為基礎的內部評級評估機制，並在考慮發行機構的人權、社會、環境、商業行為和管治等領域的準則後，授予企業或主權發行機構。

SRI附屬基金的大部份資產將以SRI評級方式進行評估。預期只有小部份資產並無SRI評級。未獲SRI評級的工具例子包括現金及存款、部份目標基金，以及暫時偏離或並不符合環境、社會或良好管治資格的投資。

適用於SRI策略的最低排除準則如下：

- (i) 在圍繞人權、勞工權利、環境及貪腐事宜的做法存在問題，以致嚴重侵犯／違反聯合國全球契約原則、經合組織跨國企業指引及聯合國工商企業與人權指導原則等原則及指引的發行機構所發行的證券；
- (ii) 業務涉及具爭議性武器（殺傷人員地雷、集束彈藥、化學武器、生物武器、貧鈾、白磷及核武器）的發行機構所發行的證券；
- (iii) 超過10%收益來自武器、軍事設備及軍事服務的發行機構所發行的證券；
- (iv) 超過10%收益來自開採動力煤的發行機構所發行的證券；
- (v) 超過20%收益來自煤炭的公用事業發行機構所發行的證券；
- (vi) 業務涉及生產煙草的發行機構所發行的證券；以及超過5%收益來自分銷煙草的發行機構所發行的證券；及
- (vii) 自由之家指數評分不足的主權發行機構所發行的證券（除非SRI附屬基金的個別投資限制另有說明）。自由之家指數是由美國研究機構自由之家編製，有關指數量度不同國家的政治權利及公民自由，並根據有關民主表現及政府運作的一系列準則對國家進行評估。就違反上述第(i)項的發行機構而言，若經過互動協作後發行機構仍不願意作出改變，SRI附屬基金將會出售有關發行機構所發行的證券。就違反上述第(ii)至(vii)項的發行機構而言，SRI附屬基金將會出售有關發行機構所發行的證券。