

关于施罗德亚洲高息股债基金

修改基金文件的公告

重要提示：本公告为重要文件。请投资者务必关注及详阅本公告。如投资者对本公告的内容有任何疑问，应寻求独立专业意见。施罗德投资管理(香港)有限公司作为施罗德亚洲高息股债基金的基金管理人，就本公告所载内容的准确性承担全部责任，并在进行一切合理查询后确认，尽其所知所信，本公告并未遗漏令本公告含有任何误导性陈述的其他事实。

施罗德亚洲高息股债基金(“本基金”)于 2017 年 5 月 24 日经中国证券监督管理委员会证监许可[2017]767 号文获准在中国内地注册及销售，并自 2017 年 7 月 28 日起在内地公开销售。除非本公告另行界定，本公告所用术语与本基金 2019 年 12 月版基金招募说明书及中国内地补充说明文件所界定的含义相同。

本基金适用于内地销售的简体中文版信托契约、中国内地补充说明文件、基金招募说明书以及中国内地产品资料概要(以下合称“基金文件”)自其发布之日起将进行如下修订：

一. 背景

本基金应遵守香港证券及期货事务监察委员会(“香港证监会”)发布的《单位信托及互惠基金守则》(“《单位信托守则》”)的规定。《单位信托守则》已经修订。本基金的信托契约已进行修订，中国内地补充说明文件、基金招募说明书以及产品资料概要已进行修订，以反映修订版《单位信托守则》的要求。

二. 根据修订版《单位信托守则》作出的修订

本次为反映修订版《单位信托守则》的要求而已经对本基金的信托契约及/或中国内地补充说明文件和基金招募说明书(如适用)作出的主要修订如下：

1. 受托人及基金管理人 – 根据修订版《单位信托守则》第 4 章和第 5 章的规定补充受托人及基金管理人的额外职责。
2. 投资限制：核心规定 – 根据修订版《单位信托守则》第 7 章对投资限制和禁止的核心要求进行修订，包括但不限于与以下内容有关的修订：投资分布、投资于商品的限制、借出款项的限制、借入款项的限额、金融衍生工具、证券融资交易及担保物等。

根据修订版《单位信托守则》对投资限制/要求作出的主要修订的摘要载于本公告附件 1。

3. 其他修订 – 为反映修订版《单位信托守则》的要求而作出的其他修订及强化披露的内容包括：

- (a) 为反映修订版《单位信托守则》中关于与关联人士进行交易及软佣金安排的要求作出的修订；
- (b) 强化关于本基金终止时，处理基金份额持有人未领款项的有关安排的披露；
- (c) 强化关于保管安排的披露；及
- (d) 强化关于估值政策及暂停计算资产净值的披露。

请参见经修订的中国内地补充说明文件、基金招募说明书和信托契约以了解进一步详情。

三. 本基金投资政策的修订

目前，本基金可为对冲的目的使用金融衍生工具，但基金管理人不一定会使用此工具。不保证基金管理人使用的任何金融衍生工具将取得预期成果。为投资目的使用的任何金融衍生工具须遵守本基金适用的投资限制。

自 2020 年 1 月 30 日起，本基金的投资政策将修订为允许本基金为对冲及投资的目的使用金融衍生工具，但基金管理人不一定会使用此工具(“投资政策变更”)。

本基金的衍生工具净敞口可最高达到本基金资产净值的 50%，本次修订对此进行强化披露。与金融衍生工具相关的风险将会加大，以反映本基金扩大使用金融衍生工具。

同时亦已进行强化披露，规定本基金可将其资产净值的最多 20%投资于具有亏损吸收特点的债务工具，例如：或有可转换债券、额外一级及二级资本票据、一级及二级资本票据、资本担保债券和总亏损吸收能力债券并对相关风险进行强化披露。

四. 其他更新及修订

除上述修订外，中国内地补充说明文件、基金招募说明书、产品资料概要及/或信托契约(如适用)的修订还包括以下内容：

- (i) 更新施罗德集团的介绍及基金管理人的董事名单；
- (ii) 变更提供若干基金登记职能的服务提供机构；
- (iii) 强化风险披露；
- (iv) 更新赎回及估值安排(内地投资者的赎回手续不受影响)；
- (v) 更新关于香港自动交换金融账户信息的披露；及
- (vi) 其他杂项更新及修订。

五. 修订的影响

由于投资政策变更，本基金将根据新的投资政策进行管理。投资政策变更不会对投资者的权利或利益造成重大不利影响。除在本公告中披露的事项外，上述修订不会导致本基金的投资目标及风险特征产生任何重大变更。从本基金的资产中支出的应付费用不会因上述修订而增加。除在本公告中披露的事项外，上述修订也不会导致本基金目前的运作及管理方式发生任何变化。

六. 文件的查阅

本基金经修订的基金文件(包括适用于内地销售的简体中文版信托契约、中国内地补充说明文件、基金招募说明书和中国内地产品资料概要)可在内地代理人网站 www.fund001.com 查阅，内地投资者也可在办公时间于内地代理人的办公场所免费查阅复印件。

七. 内地投资者可通过内地代理人交银施罗德基金管理有限公司咨询有关事项：

交银施罗德基金管理有限公司
客户服务电话：400-700-5000
电子邮箱：services@jysld.com
网址：www.fund001.com

风险提示：内地投资者投资于本基金时应认真阅读本基金适用于内地销售的简体中文版信托契约、中国内地补充说明文件、基金招募说明书以及中国内地产品资料概要等相关文件，并根据自身风险承受能力选择适合自己的基金产品。本基金依照香港法律设立，其投资运作、信息披露等规范适用香港法律及香港证监会的相关规定。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

基金管理人：施罗德投资管理(香港)有限公司
2019年12月30日

附件 1

投资限制主要修订摘要

投资限制的主要修订如下：

- (a) 本基金通过以下方式投资于任何单一实体或就任何单一实体承担风险的总价值(政府证券及其他公共证券除外)不得超过其最新可用资产净值的 10%：
 - (i) 对该实体发行的证券作出投资；
 - (ii) 通过金融衍生工具的底层资产就该实体承担风险；及
 - (iii) 因与该实体就场外金融衍生工具进行交易而产生对手方净敞口。
- (b) 根据修订版《单位信托守则》的规定，本基金通过以下方式投资于同一个集团内的实体(即一般来说，为按照国际认可会计准则编制合并财务报表而被纳入同一集团内的实体)或就同一个集团内的实体承担风险的总价值不得超过其最新可用资产净值的 20%：
 - (i) 对该等实体发行的证券作出投资；
 - (ii) 通过金融衍生工具的底层资产就该等实体承担风险；及
 - (iii) 因与该等实体就场外金融衍生工具进行交易而产生对手方净敞口。
- (c) 本基金存放于同一个集团内的实体(一个或多个)的现金存款的价值不得超过其最新可用资产净值的 20%，但在修订版《单位信托守则》规定的特定情况下可超过该 20% 的上限。
- (d) 除非香港证监会另行批准并在本基金的投资政策中进行披露，本基金不得投资于实物商品。
- (e) 根据修订版《单位信托守则》的规定，本基金不得借款、承担债务、进行担保、背书，或直接地或者或有地为任何人的义务或债务承担责任或因与任何人的义务或债务有关而承担责任。为免生疑问，符合修订版《单位信托守则》规定的逆回购交易不受此限。
- (f) 本基金的最大借款数额已降低为其最新可用资产净值的 10%。为免生疑问，符合修订版《单位信托守则》规定的证券借贷交易和销售及回购交易不受此限。
- (g) 本基金可为对冲目的取得金融衍生工具。
- (h) 本基金也可根据其投资目标及政策为非对冲目的取得金融衍生工具，但与该等金融衍

生工具有关的净敞口(“**衍生工具净敞口**”)不得超过其最新可用资产净值的**50%**,但是在香港证监会不时发布的《单位信托守则》、手册、守则和/或指引允许或由香港证监会不时允许的情形下,可以超过该等限额。

衍生工具净敞口应根据《单位信托守则》及香港证监会发布的规定和指引(可不时予以更新)进行计算。在计算衍生工具净敞口时,为投资目的取得而将在本基金投资组合层面产生递增杠杆效应的衍生工具被转换为其底层资产的等值持仓。为免生疑问,对于为对冲目的而取得的金融衍生工具,只要不会因该等对冲交易产生任何剩余衍生工具敞口,则计算上述**50%**的限额时不会将该等金融衍生工具计算在内。