

中國平安資產管理基金
中國綠色債券基金

風險披露

- 中國平安資產管理基金－中國綠色債券基金（「本基金」）主要通過債券通及/或QFII投資於大中華地區發行人所發行及其他全球市場發行人所發行與國際標準（即遵從國際信貸市場協會綠色債券原則的債券）一致的綠色債券。本基金致力於促進綠色融資以推進該地區的環保投資和社會意識。
- 本基金可能投資於（i）低於投資級別證券或並無評級的債務證券；（ii）具有虧損吸收功能的固定收益證券（在發生觸發事件時面對減值或轉換為普通股的風險，導致價值顯著或完全下降）及（iii）資產抵押證券及按揭抵押證券，該等投資項目通常均面對較高的違約、波動及流動性風險。本基金亦面臨其他與債務證券有關的風險（例如：利率、信用評級及降級、估值、可換股債券以及城投債風險），及須承受與證券借貸、場外出售及回購及/或反向回購交易相關的風險。
- 本基金的投資集中於大中華地區發行的綠色固定收益工具。本基金的表現可能低於不專注於綠色固定收益工具的基金，並本基金的價值可能比擁有更多元化的投資組合的基金更容易波動。本基金亦面臨人民幣風險以及中國稅務風險。
- 本基金可使用金融衍生工具作投資、對沖及有效率的組合管理用途。使用金融衍生工具可能令本基金面臨重大虧損風險。
- 派息概無保證。分派可以從資本中支付，這等於退回或提取投資者原本投資額的一部分或該原本投資額應佔的任何資本收益。這可能導致每股資產淨值即時下降。
- 閣下作出的投資決定須自行負責。閣下不應僅根據本月報作出投資決定。請閱讀香港銷售文件以取得更多資訊如風險因素。

投資目標

本基金旨在獲得投資收入的絕對回報及長期資本升值。本基金主要投資於大中華地區發行人所發行的與國際標準（即遵從國際信貸市場協會綠色債券原則的債券）一致的綠色債券，旨在促進綠色融資及推進該地區的環保投資及社會認知。

基金詳情

|                     |                                          |
|---------------------|------------------------------------------|
| 投資經理                | 中國平安資產管理（香港）有限公司                         |
| 註冊地                 | 盧森堡                                      |
| 基礎貨幣                | 美元                                       |
| 其他股份類別貨幣            | 港元/ 離岸人民幣                                |
| 基金成立日期              | 2019年11月8日                               |
| 基金規模                | 78.6百萬美元                                 |
| 交易頻率 <sup>(1)</sup> | 每日                                       |
| 派息政策 <sup>(2)</sup> | 每半年                                      |
| 最低投資金額              | 零售股份類別<br>-10,000美元（首次）<br>-10,000美元（後續） |
| 認購費                 | 最高5%                                     |
| 管理費                 | 每年最高1%                                   |
| 贖回費                 | 無                                        |
| 託管人及行政管理人           | HSBC Continental Europe, Luxembourg      |

組合統計數據

|                        |       |
|------------------------|-------|
| 平均到期收益率 <sup>(3)</sup> | 5.33% |
| 平均修正存續期 <sup>(3)</sup> | 3.35年 |
| 平均信貸評級 <sup>(3)</sup>  | BBB+  |

基金表現



| 累積表現          | 年初至今  | 1個月   | 3個月   | 6個月   | 1年    | 3年    | 5年     | 表現計算日至* |
|---------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|---------|
| S類美元（非對沖）(R)  | 2.23% | 0.35% | 0.59% | 1.20% | 3.92% | 6.56% | -3.35% | -2.86%  |
| RE類美元（非對沖）(D) | 1.79% | 0.26% | 0.33% | 0.68% | 2.85% | 3.30% | -      | -12.67% |
| RE類港元（非對沖）(D) | 2.80% | 1.38% | 1.15% | 1.44% | 3.17% | 3.24% | -      | -11.85% |

| 歷年表現          | 2024  | 2023  | 2022    | 2021*  | 2020  | 2019* |
|---------------|-------|-------|---------|--------|-------|-------|
| S類美元（非對沖）(R)  | 2.79% | 5.51% | -14.17% | -4.13% | 6.37% | 0.11% |
| RE類美元（非對沖）(D) | 1.72% | 4.42% | -15.07% | -4.90% | -     | -     |
| RE類港元（非對沖）(D) | 1.13% | 4.66% | -15.13% | -4.54% | -     | -     |

S類美元（非對沖）(R) 不供予香港公眾。  
 過往表現並非未來表現的指標。基金業績表現以資產淨值作為比較基礎，所得股息會滾存作再投資（如有）。（R）：資本累積。（D）：派息。2019年11月11日至2020年3月11日期間為本基金投資組合建構期。  
 本文件所示歷史表現反映了本基金在2020年8月20日轉換為可轉讓證券集體投資計劃（簡稱UCITS）之前被認定為不同類型基金（即保留型另類投資基金（簡稱RAIF））時期的表現。儘管本基金的投資目標、策略及政策在轉換時並無重大變動，所示的過往表現僅作說明之用，不應作為投資決定的依據，亦不構成對未來回報的任何保證。  
 \*S類美元（非對沖）(R) 在2019年及RE類美元（非對沖）(D) 和RE類港元（非對沖）(D) 在2021年的表現分別由該股份類別的表現計算日期計算至2019年12月31日及2021年12月31日。

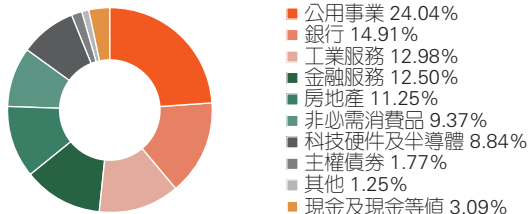
股份類別信息

| 股份類別   | S類美元（非對沖）(R) | RE類美元（非對沖）(D) | RE類港元（非對沖）(D) | RE類美元（非對沖）(R) | RE類港元（非對沖）(R) |
|--------|--------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| ISIN編碼 | LU2071385509 | LU2069541089  | LU2069542137  | LU2069540941  | LU2069542053  |
| 彭博編碼   | PINCGBS LX   | PIMGBRE LX    | PIMGBHK LX    | PIMGBUS LX    | PIMGBRU LX    |
| 表現計算日期 | 2019年11月11日  | 2021年7月8日     | 2021年7月8日     | N/A           | N/A           |
| 月終單位淨值 | 97.13美元      | 83.56美元       | 84.35港元       | N/A           | N/A           |

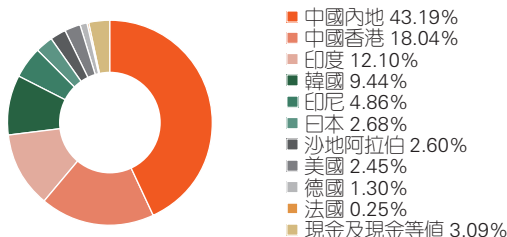
<sup>A</sup> 本基金為香港自2024年3月1日起生效之「新資本投資者入境計劃」認可的合資格集體投資計劃之一。  
<sup>1</sup> 盧森堡及香港銀行完全開放經營正常銀行業務的日子。  
<sup>2</sup> 目前於每年6月和12月就各派息類別股份宣布和分派股息。派息並不獲保證。  
<sup>3</sup> 資料來源：彭博。  
 有關本基金的進一步詳情，請參閱發售文件。

## 中國平安資產管理基金 中國綠色債券基金

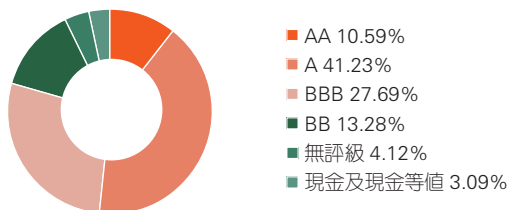
### 行業分佈 (%)



### 國家／地區分佈 (%)



### 信貸評級分佈<sup>(4)</sup> (%)



### 五大持倉 (%)

| 持倉                                    | 票息率    | 到期日        | (%)   |
|---------------------------------------|--------|------------|-------|
| Midea Investment Development Co Ltd   | 2.880% | 24/02/2027 | 5.86% |
| China Merchants Bank Co Ltd/Hong Kong | 1.200% | 10/09/2025 | 5.04% |
| Lenovo Group Ltd                      | 6.536% | 27/07/2032 | 4.14% |
| ICBCIL Finance Co Ltd                 | 2.250% | 02/11/2026 | 3.94% |
| MTR Corp Cl Ltd                       | 2.500% | 02/11/2026 | 3.72% |

### 獎項

#### 公司獎項

**Bloomberg Businessweek**  
彭博商業周刊／中文版

**ESG 2023**  
Leading Enterprise  
Special Emphasis  
ESG Investing

**ESG 2022**  
Leading Enterprise  
Theme Awards  
ESG Investing

**ESG 2021**  
Leading Enterprise  
Theme Awards  
ESG Investing

**AsiaRisk Awards 2022 Winner**

Investment house  
of the year  
Ping An

**AsiaRisk Awards 2020 Winner**

Asset management  
firm of the year  
Ping An of China  
Asset Management (Hong Kong)

#### 基金獎項

**Environmental Finance Sustainable Investment Awards 2024 Winner**  
ESG fixed income fund of the year, Asia

**Environmental Finance Sustainable Investment Awards 2023 Winner**  
ESG fixed income fund of the year – Asia

**Environmental Finance Sustainable Investment Awards 2021 Winner**  
ESG fixed income fund of the year, Asia

**BENCHMARK SUSTAINABILITY AWARDS 2023 WINNER**  
IMPACT THEMATIC - GSS BOND  
BEST-IN-CLASS

<sup>4</sup> 中國平安資產管理 (香港) 有限公司根據每隻證券或其母公司在三間評級機構 (穆迪、標普及惠譽) 中所得較高的評級，釐定信貸評級分佈。若只有一間機構賦予評級，將採用該評級。三間機構均未賦予評級的證券將反映為無評級。整體信貸評級愈低，代表投資組合的風險愈高。信貸評級以常用字母排序 (由高至低)：AAA、AA、A、BBB、BB……D。<sup>5</sup> 資料來源：《彭博商業周刊／中文版》，2021年度、2022年度和2023年度大獎分別截至2021年11月、2022年12月以及2023年11月。<sup>6</sup> 資料來源：Risk.net及《亞洲風險》(Asia Risk) 雜誌，2020年度和2022年度大獎分別截至2020年9月以及2022年11月。<sup>7</sup> 資料來源：《環境金融》(Environmental Finance)，可持續投資大獎 (亞洲年度最佳ESG固定收益基金) 2021年度、2023年度和2024年度大獎分別截至2021年6月28日、2023年6月28日及2024年6月28日。<sup>8</sup> 資料來源：《指標》(BENCHMARK)，2023香港年度基金大獎：可持續投資大獎 - 影響力投資 - 綠色、社會與可持續債券 (同級最佳) 截至2023年11月29日。

**基金分佈：**基金分佈為截至指定日期所投資資產類別 (即證券投資、銀行現金及證券應收利息的總額) 的百分比。本基金的資產類別基於本基金在一般市場情況下的主要投資。本基金可隨時改動資產類別之分佈而無須事先另行通知。因調整至最接近之數值，百分比之總和或不等於100%。**主要投資項目：**這些證券並不代表所有買入及售出的證券，亦非對客戶的建議。投資者不應假設投資於這些證券會經或將會獲利。本基金的投資經理保留發放有關主要投資項目資料的權利。**回顧及展望：**除另有註明外，文中所提及的市場數據均來自彭博。

### 聯繫我們

[asset.pingan.com.hk](https://asset.pingan.com.hk)

(+852) 3762 9292

[PUB\\_PAAMHK\\_IS@pingan.com.hk](mailto:PUB_PAAMHK_IS@pingan.com.hk)

### 免責聲明

中國平安資產管理基金 - 中國綠色債券基金 (「本基金」) 已獲香港證券及期貨事務監察委員會 (「證監會」) 認可 (證監會認可不代表證監會對本基金給予官方推薦或背書，亦不代表其對本基金的商業價值或其表現作出保證。此並不指本基金適合所有投資者，亦不指本基金對任何特定投資者或類別投資者的適合性作出背書)。本月報所載之資料未經獨立驗證，但根據在其發佈日被相信屬正確及可靠的來源。任何關於國家、市場或公司未來事件或表現的預測或其他前瞻性陳述不一定代表實際事件或結果，並且可能與實際事件或結果有所不同。不提供準確性的保證，亦不承受任何錯誤或遺漏的責任。中國平安資產管理 (香港) 有限公司 (「中國平安資產管理 (香港)」) 保留隨時修改本月報所載之任何資料的權利恕不另行通知。本月報的內容僅供參考，並非買賣任何證券的要約或招攬及提供任何投資建議或推薦。投資涉及風險，投資者不應單憑本月報而作出投資決定。過去表現不代表將來表現。基金價格可升可跌，有可能令投資者損失部分或全部投資本金。本月報由中國平安資產管理 (香港) 刊發，並未經證監會審核。

欲獲取中國平安資產管理 (香港) 有限公司的更多信息，請訪問網站：<https://asset.pingan.com.hk> (此網站未經證監會審閱)