

中國平安資產管理基金
可變資本投資公司 – 可轉讓證券集體投資計劃
以公眾有限責任公司的形式
4, rue Peternelchen, L-2370 Howald
R.C.S. Luxembourg: B 226818
(「本公司」)

致本公司股東的通告
中國平安資產管理基金—新興市場收益基金
中國平安資產管理基金—中國高收益私募策略債券基金
中國平安資產管理基金—中國綠色債券基金
中國平安資產管理基金—中國 A 股人工智能多因子基金
(各稱「子基金」，統稱「各子基金」)

警告：本文件乃重要文件，務請閣下即時垂注。閣下如有任何疑問，請諮詢專業意見。董事會對本通告（「本通告」）所載資料的準確性承擔全部責任。董事會已採取合理措施，以確保本通告所載資料在本通告日期於所有重大方面均屬真實及準確，並且就董事會所深知及確信，並無遺漏任何其他重大事實致使任何聲明產生誤導。除非本通告另有定義，否則本通告所載詞彙應與本公司日期為 2021 年 2 月的說明書（「說明書」）及日期為 2021 年 6 月的香港投資者補充文件（「香港補充文件」）（合稱「香港發售文件」）所述者具有相同涵義。

敬啟者：

董事會謹此通知閣下以下變動將由 2023 年 6 月 30 日（「生效日期」）起生效：

1. 中國高收益私募策略債券基金的修訂

現時，子基金的投資目標是主要投資於中國內地的主權、主權機構及 / 或主要業務在中國內地的公司發行的高收益證券。由生效日期起，為適應不斷變化的市場及把握更多機會，董事會已決定擴大子基金主要投資的地域範圍至大中華地區，即中國內地、澳門、香港及台灣。此外，為擴大子基金在大中華以外地區進行輔助投資的能力，董事會已決定將主要投資上限從淨資產的最少 70% 降低至最少 60%。

因此，由生效日期起，投資目標及投資策略將修訂如下：

「投資目標

子基金致力透過主要投資於大中華地區的主權、主權機構及 / 或主要業務在中國內地大中華地區的公司發行或與之有關連的高收益證券以獲得投資收入的絕對回報及長期資本升值。

投資策略

子基金最少將其淨資產的 6070%投資於由中國內地大中華地區的主權及 / 或主權機構或主要業務在中國內地大中華地區的公司發行或與之有關連的債務證券 (包括 (其中包括) 債券、可換股債券、高收益企業債券、企業債務及參與貸款的票據) ...」

基於上述變動，股東將承受子基金投資於大中華地區的集中風險。

除上述披露外，該等變動不會導致適用於子基金的特徵及風險出現任何其他轉變。除上述變動外，子基金的營運及 / 或管理方式並無改變，對現有股東亦無任何影響。有關變動亦不會引起可能對現有股東權利或利益造成重大損害的事項或影響。

2. 中國綠色債券基金的修訂

現時，子基金的主要投資策略是最少將其淨資產的 70% 投資於主要由大中華地區的發行人 (包括主權、半主權、超國家、金融機構及公司) 發行的固定收益工具。為擴大子基金在大中華以外地區進行輔助投資的能力，董事會已決定將有關上限從淨資產的最少 70% 降低至最少 60%。

因此，由生效日期起，投資策略將修訂如下：

「子基金至少將 6070% 的淨資產投資於綠色固定收益工具，此等工具主要由大中華地區的發行人 (包括主權、半主權、超國家、金融機構及公司) 發行，包括通過債券通在中國銀行間債券市場 (「中國銀行間債券市場」) 及 / 或通過人民幣合格境外機構投資者 (「QFII」) 在中國內地投資。此類固定收益證券包括城投債，即由地方政府融資平台 (「地方政府融資平台」) 發行並於中國交易所債券市場及銀行間債券市場交易的債務工具。子基金亦可透過將餘下淨資產投資於具有類似投資目標的其他全球市場，將其投資策略多元化。子基金通過 QFII 於中國內地證券的投資將不會多於其淨資產的 60%。子基金最少 70% 的資產將符合綠色固定收益工具的資格。」

上述變動將不會導致適用於子基金的特徵及風險出現任何轉變。

3. 中國 A 股人工智能多因子基金的修訂

現時，子基金最少將其淨資產的 70% 透過滬深港股票市場交易互聯互通機制 (「股票市場交易互聯互通機制」) 主要投資於在中華人民共和國發行並在上海證券交易所及

深圳證券交易所上市公司的 A 股（「中國 A 股」）。為分散子基金於中國 A 股的投資，由生效日期起，子基金亦可透過合格境外機構投資者（「QFII」）制度投資於中國 A 股。

因此，由生效日期起，投資策略將修訂如下：

「子基金最少將其淨資產的 70% 透過合格境外機構投資者（「QFII」）制度及 / 或滬深港股票市場交易互聯互通機制（「股票市場交易互聯互通機制」）主要投資於在中華人民共和國（「中國」）發行並在上海證券交易所及深圳證券交易所上市公司的 A 股（「中國 A 股」）。」

上述變動將不會導致適用於子基金的主要特徵及風險狀況出現任何重大轉變。股東須注意，由於子基金亦可透過 QFII 進入中國 A 股市場，因此亦將承受與 QFII 相關的風險。有關與 QFII 相關的主要風險的說明，請參閱說明書。

4. 歐洲議會及理事會 2019 年 11 月 27 日關於金融服務業可持續性相關披露的 (EU)2019/2088 規例（經修訂）（「SFDR」）之相關變動

香港發售文件將予修訂，以符合 SFDR，包括納入 SFDR 第 8 條第 1、2 和 2a 段，以及 (EU) 2020/852 規例第 6 條第 1 段所述的金融產品合約前披露範本，作為附錄 1。

在不限上述內容的一般性的情況下，附錄 1 將就中國綠色債券基金披露：

- 子基金不會投資於符合歐盟分類規例的化石天然氣及 / 或核能相關活動；及
- 子基金最多將其資產淨值的 5% 投資於過渡性及輔助資產。

5. 其他變動

香港發售文件亦將予更新，以反映下列變動：

- 作出修訂，以詳細說明低於投資級別的投資：
 - 若不同信貸評級機構授予的信貸評級有別，則採用最低評級；
 - 「未經評級」是指標準普爾、惠譽或穆迪均未提供評級；及
 - 低於投資級別的投資包括投資經理以其他方式釐定為具備相若質素的投資，即使信貸評級高於 BB+（由標準普爾或同等機構評定）；
- 本公司的新註冊辦事處為 4, rue Peternelchen, L-2370 Howald, Grand Duchy of Luxembourg；
- 任命新的公司及本地代理（以一家公司的方式）；
- 董事會的新組成如下：

- Ran LI 先生；
- John ALLDIS 先生；及
- Siu Kay Gordon TSUI 先生。
- 管理公司董事會的新組成；
- 作出更新，以闡明各子基金對輔助流動資產的投資須以其資產淨值的 20% 為限；
- 若干其他法律、監管及編輯更新

除本通告另有披露外，本通告中詳述的變動將不會 (i) 對適用於子基金的特徵及風險構成重大轉變；(ii) 導致子基金的營運及 / 或管理方式出現其他轉變，及因此不會對現有股東造成重大影響；或(iii) 對現有股東的權利或利益造成重大損害。與上述變動有關的費用及支出總額估計約為 120,000 港元，並將由各相關子基金參考其各自的資產淨值攤分及承擔。

若閣下基於上述變動而不希望繼續投資於本公司，可在本通告日期起一個月內向香港代表提出要求，按照香港發售文件所述程序贖回閣下的股份，費用全免。請注意，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。

香港發售文件及各子基金產品資料概要的經修訂版本將反映上述變動。香港發售文件的現有版本可於任何香港營業日的一般營業時間內在香港代表辦事處免費索取，地址為香港中環金融街 8 號國際金融中心二期 23 樓 2301 室。

閣下如對上述內容有任何疑問，請聯絡管理公司於盧森堡的註冊辦事處或香港代表（地址為香港中環金融街 8 號國際金融中心二期 23 樓 2301 室、電郵：PUB_PAAMHK_IS@pingan.com.hk 或電話：+852 37629292）。

此致

承董事會命
2023 年 5 月 30 日