

重要资料：本公告乃重要文件，请投资者即时关注。如投资者对本公告的内容有任何疑问，请咨询专业意见。基金管理人对本公告所载信息的准确性承担责任。

关于东方汇理香港组合-创新动力股票基金 将 ESG 考虑因素纳入投资策略并修改招募说明书的公告

除非本公告另有注明，本公告所使用的术语应具有东方汇理香港组合-创新动力股票基金(“本基金”)适用于内地销售的《东方汇理香港组合-创新动力股票基金招募说明书》(“《招募说明书》”)中所界定的相同涵义。

本公告旨在告知内地投资者，本基金及其《招募说明书》自 2021 年 11 月 30 日起作出以下变更。

一. 本基金将 ESG 考虑因素纳入本基金的投资策略

为符合东方汇理集团提倡 ESG 特点的全球政策，自 2021 年 11 月 30 日起，本基金的投资策略将作出下列变更：

- (a) 本基金的投资策略将予以修订，以反映其将在投资流程中纳入可持续发展因素¹，更多详情请参阅本公告附录。
- (b) 本基金的投资策略将进一步修订，以纳入增加的目标，即力求使其投资组合实现高于其参考指数的 ESG 评分。在确定本基金及其参考指数的 ESG 评分时，通过比较某证券相对于证券发行人所属行业在环境、社会及管治的三个 ESG 特点各自的平均表现，从而评估 ESG 表现。通过东方汇理集团的 ESG 评级方法选择证券，将根据本基金的性质考虑投资决策对可持续发展因素的主要不利影响。关于东方汇理的 ESG 评级方法的更多详细情况，请参阅本公告附录。

由于上述变更，导致本基金可能面临本公告附录“可持续投资风险”中所述的风险。

据此，《招募说明书》之基金说明书增加“可持续投资”一节；《招募说明书》之补充说明书第十部分“对内地投资者有重大影响的信息”下“2. 本基金的投资目标、政策和投资限制”中“投资策略”部分及《招募说明书》之基金说明书“释义”一节及“附录七”下“子基金的投资目标及政策”中“投资策略”部分亦进行相应修订；《招募说明书》之基金说明书的“风险因素”一节亦增加“可持续投资风险”一节，及“附录七”下“所涉风险”一节亦进行相应修订。

二. 更新互联互通机制相关的风险披露

¹ “可持续发展因素”指环境、社会及雇员事宜、尊重人权、反贪污及反贿赂。

2021年1月22日,香港联合交易所宣布自2021年2月1日起将在上海证券交易所科创板(“科创板”)上市的合资格中国A股纳入互联互通机制。此外,深圳证券交易所于2021年4月6日正式将主板与中小板合并。

据此,《招募说明书》之基金说明书“互联互通机制”一节及“风险因素”下“与互联互通机制有关的风险”一节进行相应修订,即一方面补充科创板的有关信息和科创板相关风险,另一方面反映深圳证券交易所主板与中小板的合并。

三. 《招募说明书》的其他修订

1. 《招募说明书》之补充说明书的第九部分“内地投资者服务”下“2. 资料查询和发送”一节进行修订,明确内地投资者有权获取对账单,具体的对账单获取方式以内地销售机构为准。
2. 《招募说明书》之基金说明书“互联互通机制”一节进行修订,以反映香港投资者赔偿基金对互联互通机制的北向交易进行了保障。
3. 其他优化调整。

四. 变更的影响

为免生疑问,本公告所述的变更预计不会导致本基金主要特点(包括其投资目标、策略及整体风险状况)的重大变动。该等变更亦不会导致本基金运作或管理方式有任何重大变更。除本公告另有披露外,本公告所述变更不会导致本基金费用水平的其他变动。

五. 文件查阅

本基金的《招募说明书》将适时更新,以反映上述更新。现行版本的《招募说明书》可在内地代理人网站(www.abc-ca.com)查询。请浏览该网站以了解更多详情。

如投资者对本公告的任何方面有任何疑问或需要进一步的资料,请联络本基金的内地代理人农银汇理基金管理有限公司。

农银汇理基金管理有限公司
内地代理人客服热线: +86-400-68-95599
内地代理人公司网址: www.abc-ca.com
内地代理人客服邮箱: service@abc-ca.com.cn

六. 重要提示

1. 投资者在办理基金交易前，请仔细阅读登载在本基金内地代理人的网站(www.abc-ca.com)的本基金适用于内地销售的《招募说明书》《产品资料概要》及《信托契约》等相关法律文件及公告，并确保遵循其规定。
2. 本基金作为香港互认基金在内地公开销售，其投资运作、风险特征、法律法规适用等与内地基金产品不同，敬请投资者认真阅读上述本基金法律文件及公告(包括当中的风险揭示内容)，谨慎做出投资决策。

七. 风险提示

投资涉及风险(包括可能会损失投资本金)，基金份额净值可升可跌，过往表现并不可作为日后表现的指引。投资前请参阅本基金适用于内地销售的《招募说明书》《产品资料概要》及《信托契约》等相关法律文件及公告所载详情，包括投资于本基金的主要风险、对于内地投资者的特殊风险以及有关本基金作为香港互认基金的特有风险。

本基金系依据《香港互认基金管理暂行规定》经中国证券监督管理委员会注册后在内地公开销售的香港互认基金。但中国证券监督管理委员会对本基金的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人就本公告内容之准确性承担责任。

特此公告。

基金管理人：东方汇理资产管理香港有限公司
2021年10月29日

附录

责任投资政策概要

自创立以来，东方汇理集团公司(“东方汇理”)就将责任投资及企业责任视为创立基石之一，其背后的信念是经济及金融参与者对可持续社会肩负更大责任，以及 ESG 是财务表现的一项长远动力。

东方汇理认为，除经济及财务方面以外，在投资决策流程中纳入 ESG 因素，包括可持续发展因素及可持续性风险²，能够更全面地评估投资风险及机会。

东方汇理纳入可持续性风险

东方汇理已制定其自身的 ESG 评级方法。东方汇理 ESG 评级旨在衡量发行人的 ESG 表现，即其预测及管理可持续性风险的能力和预测及管理其所属行业的内在机会以及其独有能力的机会。基金经理通过运用东方汇理 ESG 评级，在投资决策中将可持续性风险纳入考量因素。

东方汇理对东方汇理的所有主动投资策略采取针对性排除政策，方法是排除违反责任投资政策的公司，例如不尊重国际公约、国际公认框架或全国性规定的公司。

东方汇理已基于“同类最佳”方法制订其自身的内部 ESG 评级流程，针对每个业务类别采纳的评级旨在评估公司营运所处的环境。

ESG 评级和分析由东方汇理的 ESG 分析团队进行，亦用作决策流程的独立及补充参数，详见下文。

东方汇理 ESG 评级是一个 ESG 量化评分，换算为 A(最佳评分区间)至 G(最差)七个等级。在东方汇理的 ESG 评级表中，属于排除名单的证券对应的等级为 G。

在确定本基金及其参考指数的 ESG 评分时，将考虑本基金及参考指数的相关证券的 ESG 表现(即按上文所述的东方汇理的 ESG 评级方法确定的 A 至 G 评级)。对于公司发行人发行

² “可持续性风险”是指一旦发生则可能会对投资的价值造成实际或潜在的重大不利影响的环境、社会或管治事件或状况，包括但不限于气候变化、自然资源枯竭、环境恶化、践踏人权、贿赂、贪污及社会和雇员事宜引发的风险。

的证券，通过下列三个 ESG 因素比较相关证券的平均表现与发行人所属行业的平均表现，以此评估 ESG 表现：

1. 环境因素：衡量发行人通过限制其能源消耗、减少其温室气体排放、应对资源枯竭和保护生物多样性而控制其对环境直接和间接影响的能力。
2. 社会因素：衡量发行人如何处理两个截然不同的概念：发行人发展其人力资本的策略及普遍尊重人权。
3. 管治因素：评估发行人确保有效企业治理框架及长期产生价值的基础的能力。

东方汇理 ESG 评级采纳的方法采用了 37 项一般性标准(所有公司无论其活动类型均通用)或业务类别特有的标准，并根据业务类别加权，并在其对发行人的声誉、营运效率及规则的影响方面予以考虑。

东方汇理 ESG 评级亦考虑发行人业务活动对可持续性的潜在负面影响(由东方汇理确定投资决策对可持续发展因素的主要不利影响)，包括下列因素：

- 温室气体排放及能源表现(排放及能源使用标准)
- 生物多样性(废弃物、回收、生物多样性和污染准则，负责管理森林标准)
- 水资源(水资源标准)
- 废弃物(废弃物、回收、生物多样性和污染标准)
- 社会及雇员事宜(社会参与及人权标准、雇佣常规标准、董事会结构标准、劳工关系标准和治疗及安全标准)
- 人权(社会参与及人权标准)
- 反贪污及反贿赂(道德标准)

由基金管理人及副投资管理人(如有)³确定本基金纳入 ESG 分析的方式及程度(例如基于 ESG 评分)。

关于东方汇理的责任投资政策及评级方法的更多详细资料，载于网站 www.amundi.com.hk。此网站并未经香港证监会审核。

可持续投资风险

³ 本基金暂无副投资管理人。

基金管理人及副投资管理人(如有)在代表本基金作出投资时,会考虑投资决策对可持续发展因素的主要不利影响。在管理该等本基金及挑选该等本基金将投资的资产时,基金管理人及副投资管理人(如有)运用基金管理人的责任投资政策。

本基金的投资范围可能专注投资于符合特定标准(包括 ESG 评分及展现对环境、社会及企业管治的遵守)的公司。因此,本基金的投资范围可能小于其他基金。本基金可能出现(i)在该等底层投资表现逊于市场,及/或(ii)本基金表现逊于在选择投资时不采用 ESG 准则的其他基金,及/或可能导致本基金因 ESG 相关考虑而出售当时表现良好或随后表现良好的投资。

从本基金的投资范围中排除或出售不符合特定 ESG 准则的发行人的证券,可能会导致本基金的表现不同于并无此类责任投资政策及在拣择投资时不采用 ESG 筛选标准的同类基金。

本基金将以符合相关 ESG 排除准则的方式投票,这可能未必一定总是符合相关发行人短期表现最大化的目标。关于东方汇理的 ESG 投票政策的更多资料,载于 www.amundi.com.hk。此网站并未经香港证监会审核。

ESG 评估方法缺乏标准化的分类法,且采用 ESG 准则的不同基金运用该准则的方式可能各有不同。基金管理人及副投资管理人(如有)在分析及评估某证券或其发行人的 ESG 评分时,将采用自身的方法,当中涉及其主观判断。存在基金管理人或副投资管理人(如有)可能不正确地运用相关绿色准则的风险,或本基金可能间接持有不符合本基金所采用的相关 ESG 准则的发行人发行的证券的风险。

选择资产可能依赖自有的 ESG 评分流程,而该流程部分依赖第三方数据。第三方提供的数据可能不完整、不准确或未能提供,因此,基金管理人或副投资管理人(如有)可能会不准确地评估某证券或发行人。

本基金持有的证券可能会在本基金作出投资后出现风格转变,导致不再符合本基金的 ESG 准则。基金管理人及副投资管理人(如有)可能需要出售该等证券且此举有可能是有利的。这可能会导致本基金的资产净值下跌。