

路博邁投資基金  
註冊辦事處  
70 Sir John Rogerson's Quay  
Dublin 2, Ireland

各子基金之間獨立負債的傘子型基金

路博邁投資基金的董事（「董事」）就本通函所載資料的準確性承擔全部責任，並於作出一切合理查詢後確認，就彼等所知及所信，概無遺漏會導致任何陳述產生誤導的其他事實。

本通函乃重要文件，務須閣下即時垂注。如閣下對應採取的行動有任何疑問，閣下應向閣下的股票經紀、銀行經理、律師、會計師、稅務顧問或其他獨立財務顧問諮詢意見。如閣下已將閣下所有股份出售或轉讓，請立即將本通函轉交買方或承讓人或經手該項出售或轉讓的股票經紀、銀行或其他代理以便盡快轉交買方或承讓人。

親愛的香港股東：

路博邁投資基金（「本公司」）

- **NB 全球債券基金**
- **NB 策略收益基金**
- **NB 高收益債券基金**
- **NB 短期高收益債券基金**
- **NB 歐洲高收益債券基金**
- **NB 新興市場債券基金 - 當地貨幣**
- **NB 新興市場債券基金 - 強勢貨幣**
- **NB 新興市場企業債券基金**
- **NB 短期新興市場債券基金**
- **NB 新興市場綜合債券基金**
- **NB 美國多元企業機會基金**
- **NB 美國小型企業基金**
- **NB 中國股票基金**
- **NB 新興市場股票基金**
- **NB 美國房地產基金**
- **NB 智能動力基金**
- **NB 5G 基金**
- **NB 全球房地產基金**
- **NB 中國債券基金**
- **NB 可持續亞洲高收益基金（統稱「各投資組合」）**

董事：Gráinne Alexander、Tom Finlay、Michelle Green (英國籍)、Naomi Daly及Alex Duncan (英國籍)

公司註冊辦事處編號：336425

茲致函身為本公司股東的閣下。本通函旨在通知閣下多項對本公司及其若干子基金（「各投資組合」）作出的主要更改，有關更改將於經修訂香港銷售文件（包括香港說明文件、招股章程、相關補充文件及產品資料概要）（統稱「香港銷售文件」）中反映，預期將於2022年8月19日獲愛爾蘭中央銀行（「中央銀行」）確認，惟須經中央銀行批准。除非本通函另有訂明，招股章程及補充文件的更改將由該日期（「生效日期」）起生效。所有在本通函中使用而未有界定的詞彙具有在現有香港銷售文件中賦予該等詞彙的涵義。

## 1. 招股章程之更改

### a) 認可市場之修改

招股章程「附錄一 認可市場」內所載的認可交易所及市場清單已予更新，以包含北京證券交易所的提述。請注意，北京證券交易所乃受監管、定期營運，以及獲認可及公開予公眾人士。

### b) 隨著時間推移對若干風險披露作出更新

隨著時間推移已對若干風險披露作出多項更新，包括「流行病、大流行病、疾病爆發及公共衛生問題」披露、「倫敦銀行同業拆借利率停用」披露及「利率風險；浮動/固定息率或基準錯配；時間錯配及經修訂息率」披露，以反映有關 Covid-19 大流行病及倫敦銀行同業拆借利率停用之更新。

### c) SFDR 附錄之修改

招股章程「SFDR 附錄」內所載的披露已作出多項更改，以反映可持續金融披露規例（SFDR）及分類規例最近帶來的監管變更。

SFDR 附錄已載入一項有關路博邁 ESG 商數的新披露，路博邁 ESG 商數是用於本公司的專屬 ESG 評級系統，並構成每個已分類為第 8 條或第 9 條投資組合的投資組合之投資過程的一部分。由於 ESG 評級系統目前構成此等投資組合的投資決策過程的一部分，故這項更新並不影響任何相關投資組合現時的管理方式。

ESG 商數對發行人的環境、社會及管治特徵在重大 ESG 因素（相對於其同行群組）上分配比重，以產生 NB ESG 商數評級。擁有良好及/或正在改善的 NB ESG 商數評級的發行人較高機會被納入相關投資組合。NB ESG 商數評級差劣的發行人，特別是差劣的 NB ESG 商數評級未被發行人正視時，更有可能被排除在投資領域之外或從相關投資組合中撤資。此外，與 NB ESG 商數評級差劣的發行人進行建設性聯繫，以評估問題是否獲得充分解決。

除上文所述外，招股章程「SFDR 附錄」中「考慮投資決定對可持續性因素的不利可持續性影響」分節已載有進一步資料。務須注意，經理人及 / 或副投資經理將就每個第 8 條及第 9 條投資組合在產品層面考慮有關可持續性因素的主要不利影響指標（「PAI」）。此外，如第 8 條或

第 9 條投資組合大量投資於主權證券，該投資組合可考慮主權主要不利影響指標（「主權 PAI」）。如果每個 PAI 及（如相關）每個主權 PAI 有足夠、可靠及可核實的數據覆蓋範圍，每個第 8 條及第 9 條投資組合將考慮該等指標。倘若該等數據未可供使用，則直至在有關數據變得可用前相關 PAI 及 / 或主權 PAI 不會予以報告。

然而，儘管有上文所述，經理人及副投資經理現時並不在機構層面考慮其投資決定對可持續性因素的主要不利影響。

就上文之目的而言，請注意，以下有關「主要不利影響指標」及「主權主要不利影響指標」的定義已載入招股章程：

**主要不利影響指標** 溫室氣體排放量、碳足跡、投資對象公司的溫室氣體強度、對活躍於化石燃料界別的公司的投資參與、非可再生能源消耗和生產的分佔份額、每個高影響氣候界別的能源消耗強度、對生物多樣性敏感地區產生負面影響的活動、水域排放量、有害廢料和放射性廢料的比率、違反聯合國全球盟約原則及經合組織跨國企業準則、欠缺監控遵從聯合國全球盟約原則及經合組織跨國企業準則的過程及合規機制、未經調整的性別薪酬差距、董事會性別多樣性及投資參與爭議性武器（富殺傷力地雷、集束彈藥、化學武器和生物武器）；

**主權主要不利影響指標** 溫室氣體強度及受社會違規影響的被投資國家；

## 2. 補充文件之更改

### a) *NB 中國債券基金之更新*

為了精簡資源以更有效率地管理 NB 中國債券基金，路博邁亞洲有限公司將不再向 NB 中國債券基金提供投資管理服務。此投資組合的補充文件因此已予更新以反映由生效日期起，路博邁亞洲有限公司不再擔任其中一位對此投資組合委任的副投資經理。

### b) *NB 全球債券基金之更新*

此投資組合的補充文件已予更新，以修訂可在為了有效投資組合管理、投資目的及/或對沖目的實現投資組合現有投資策略時運用的金融衍生工具清單，以包括通脹掛鈎掉期、利率掉期期權及不可交付遠期貨幣合約，以及 UCITS 合資格債券指數及貨幣的期權。

此投資組合的補充文件亦已更新以反映由 2022 年 7 月 1 日起，投資組合 A 類別的最高管理費將由 0.80% 降低至 0.40%。

### c) *NB 短期高收益債券基金之更新*

由 2022 年 4 月 6 日起，此投資組合的補充文件已予更新，以反映適用基準指數洲際交易所美銀美國高收益指數（前稱洲際交易所 / 美銀美林美國高收益指數）最近進行品牌重塑。

此外，此投資組合的補充文件「環境、社會及管治（「ESG」）」一節已予更新，以納入與投資對象公司制定與聯合國可持續發展目標符合一致的目標時產生的聯繫過程的進一步資料。此節亦已予更新以納入有關用作為副投資經理對證券進行 ESG 評估之一部分的準則的進一步資料。對於此投資組合，一般而言，企業證券（例如：定息及浮息高收益及投資級別企業債券及貸款、股本證券及可轉換債券）會由投資組合的 ESG 評估所涵蓋。就投資組合而言，通常不被 ESG 評估所涵蓋的證券類型包括但不限於政府債務證券及現金或現金等價物，並且將佔投資組合的資產淨值最多 10%。此投資組合在招股章程「SFDR 附錄」中的相關披露亦已作出相應更新。

d) **NB 新興市場股票基金之更新**

考慮到此投資組合的相關持股上市、買賣及交易所在的市場，此投資組合對「營業日」的定義已予更新（修改之處以粗體字和底線標示）為「在倫敦及、紐約及香港的相關金融市場營業之日（星期六或星期日除外），惟如在以上任何日子，香港的銀行開門進行正常買賣的期間因熱帶氣旋警告信號（8 號或以上）、黑色暴雨警告信號或其他類似事件而被縮短，則該日不應為營業日，除非董事另行決定則作別論」。由於此項更改，此投資組合在一個曆年內的營業日數目可能會減少。

e) **NB 智能動力基金及 NB 5G 基金之更改**

以上投資組合的補充文件「環境、社會及管治（「ESG」）」一節已予更新，以納入有關副投資經理目前所實施投資過程作為其為此等投資組合考慮多個環境及社會特徵之一部分的進一步資料。

具體而言，此等環境及社會特徵乃運用路博邁專屬的 ESG 評級系統（「NB ESG 商數」）予以考慮。為說明起見，以下是副投資經理納入至公司的 NB ESG 商數中的某些特定考慮因素：

- 副投資經理評估生物多樣性及水資源壓力作為公司 ESG 分析的一部分，影響每家公司的 NB ESG 商數評級，從而影響該策略的發行人挑選。
- 當一個壓迫性政權是公司的主要股東時，副投資經理將在其由下而上的 ESG 評估中對此作出考慮。

此外，此投資組合在招股章程「SFDR 附錄」中的相關披露亦已作出相應更新。

投資者應注意，NB 智能動力基金及 NB 5G 基金目前並未獲香港證券及期貨事務監察委員會（「證監會」）認可為香港的 ESG 基金，並且不會因以上的更改而獲此認可。

f) *NB 美國小型企業基金之更改*

此投資組合的補充文件「環境、社會及管治 (「ESG」)」一節已予更新，以納入在「環境、社會及管治 (「ESG」)」一節內有關所應用的排除項目的進一步資料，以澄清投資組合並不購買從包括槍械、煙草、賭博、成人娛樂及煤炭的實務產生具意義收益的發行人的證券。

g) *NB 全球債券基金及 NB 策略收益基金之更改*

請注意，此等投資組合各自的補充文件已予更新以訂明此等投資組合不會使用證券借貸。

h) *NB 可持續亞洲高收益基金之更改*

此投資組合的補充文件已予更新以刪去使用專屬人權指標作為排除措施的提述。除上述更新外，此投資組合的 ESG 政策及策略其餘的內容並無任何變更。此投資組合仍然是獲證監會認可的 ESG 基金。

### 3. 香港說明文件之更改

a) *更新 NB 短期高收益債券基金促進的環境或社會特徵*

作為淨零碳排放資產管理公司倡議的一部分，為了使NB短期高收益債券基金可達致淨零碳目標，香港說明文件「投資限制」一節下有關此投資組合的分節的第一段已由2022年4月21日起作出修訂（修改之處以下以粗體字和底線標示）。

「為澄清起見，為了使NB短期高收益債券基金可達致淨零碳目標，副投資經理擬減少透過向碳強度較低的公司分配資本而為實現巴黎氣候協定 (Paris Climate Agreement) 作出貢獻，從而使NB短期高收益債券基金在範疇1、2及主要範疇3的溫室氣體排放<sup>2</sup>的碳足跡，相對於的碳強度相對於由州際交易所 / 美銀美林美國高收益指數代表的廣泛美國高收益市場持續低30%，以及與2019年基線水平（即NB短期高收益債券基金截至2019年12月31日的碳足跡），至2030年前減少相當於50%之排放，隨後至2050年前降至淨零碳。由於數據質素及披露隨著時間而擴展，特別是在範疇3排放方面，2019年基線或須重新計算。有關路博邁對淨零碳排放資產管理公司倡議的承諾的進一步詳情，載於愛爾蘭招股章程中標題「可持續投資準則」一節強度）相比，達至每年減低7%的碳強度。」

為免生疑問，此投資組合的ESG目標並無任何變更。碳排放減少仍然是此投資組合一個而非唯

<sup>2</sup> 範疇 1 排放是來自發行人所擁有或控制的來源的直接排放（例如：由該發行人的業務過程或來自發行人所擁有的車輛直接產生的排放）。範疇2排放是發行人所消耗的電力、蒸汽、加熱和冷卻產生的間接排放。範疇3排放是發行人的價值鏈中發生的所有其他間接排放（例如：來自發行人所消費的產品或服務的排放、其廢物的處置、僱員通勤、其產品或投資的分銷和運輸）。

一的ESG目標及特徵。除了以上的更新外，此投資組合的ESG政策及策略其餘的內容並無任何變更。此投資組合仍然是獲證監會認可的ESG基金。

請注意，香港銷售文件亦已作出多項額外、輕微的修改，包括加強若干投資組合的「投資方法」披露、為符合一致、貫徹及澄清的編輯修改，亦已作出部分隨時間轉變而在本通函中並無特別提述的更改。香港銷售文件亦可能於本通函日期之後作出進一步修改，以回應中央銀行在其審閱香港銷售文件時提出的意見。

除本通函另有披露外及為免生疑問，上述更改(a)不會對(i)各投資組合的投資目標及政策；(ii)各投資組合的營運及管理方式；及(iii)各投資組合的特點及整體風險概況造成重大影響及(b)不會提高各投資組合及股東應付的費用水平。同時預期股東不會因以上更改而受到嚴重影響或損害。最後，因上文所論述更改而招致的成本將由各相關投資組合按其基金規模之比例承擔，估計少於本公司所有子基金的總資產淨值的0.25個基點。

請注意，閣下無需回覆本通函，其僅作為通知用途。股東如因本通函所載的建議更改而無意維持在各投資組合中的投資，可要求根據香港銷售文件所載的正常程序於任何交易日贖回或轉換其股份。現時，本公司並無就贖回或轉換股份收取任何贖回或轉換費用。然而，請注意，股東或須就贖回或轉換股份向經手其投資的中介人/分銷商支付額外費用及服務收費，其金額由股東與相關中介人/分銷商協定。

經修訂的香港銷售文件一經中央銀行確認及經證監會認可，經修訂的香港銷售文件將於正常營業時間內在香港代表位於香港中環康樂廣場1號怡和大廈20樓的辦事處可供免費查閱，以及可在香港代表的網站 [www.nb.com](http://www.nb.com) 瀏覽（香港投資者應注意，此網站並未經證監會審閱，並可能載有未經證監會認可的基金的資料）。

如閣下對此事宜有任何疑問，請隨時聯絡閣下的銷售代表，或與路博邁在香港的客戶服務團隊聯絡（電話：+852 3664 8868）。



---

**董事**  
**路博邁投資基金**

謹啟

2022年6月24日