

# 滙豐環球投資基金-環球低碳債券(本基金配息來源可能為本金)

## 投資人須知【第一部分：基金專屬資訊】

刊印日期：2020年10月30日

- (一) 投資人申購前應詳閱投資人須知(包括第一部分及第二部分)與基金公開說明書中譯本。  
 (二) 境外基金係依外國法令募集與發行，其公開說明書、財務報告、年報及績效等相關事項，均係依該外國法令規定辦理，投資人應自行了解判斷。

壹、基本資料			
基金中英文名稱	滙豐環球投資基金-環球低碳債券(本基金配息來源可能為本金) HSBC Global Investment Funds – Global Lower Carbon Bond	成立日期	2017/9/27
基金發行機構	滙豐環球投資基金 HSBC Global Investment Funds	基金型態	開放式公司型
基金註冊地	盧森堡	基金種類	債券型
基金管理機構	滙豐投資基金(盧森堡)有限公司	國內銷售基金級別	AC、ACHEUR、ACHGBP、ADHEUR、ADHGBP、AD、AM2、AM2HKD、AM3HAUD、IC、ID
基金管理機構註冊地	盧森堡	計價幣別	美元
總代理人	滙豐中華證券投資信託(股)公司	基金規模	4.0675億美元 (截至2020年9月30日)
基金保管機構	HSBC France, Luxembourg Branch	國人投資比重	0.69% (截至2020年9月30日)
基金總分銷機構	全球經銷商：HSBC Investment Funds (Luxembourg) S.A.	其他相關機構	N/A
收益分配	AM2(月配)、AM2HKD(月配)、AM3HAUD(月配)、AD(年配)、ADHEUR(年配)、ADHGBP(年配)、ID(年配)	基金保證機構	無(本基金非保證型基金)
績效指標 benchmark	彭博巴克萊環球綜合企業多元指數(美元避險)	保證相關重要資訊	無(本基金非保證型基金)

## 貳、基金投資標的與策略(簡介)(相關詳細資訊請參閱公開說明書中譯本第3.2節「子基金詳情」)

**投資標的：**本基金投資於(通常最少達其淨資產的90%)：(1)會考量碳足跡及/或「綠色債券」(所得款項投資於以氣候或其他環境可持續性為目標的項目的固定收益證券)的公司所發行的投資級別及非投資級別固定收益及其他相近類型證券。本子基金將投資於已開發市場及新興市場。該等投資將以已開發市場及新興市場的貨幣計價。(2)資產抵押證券及不動產抵押貸款證券。

**投資策略：**本基金旨在透過投資於公司債券的投資組合，尋求較其參考基準彭博巴克萊環球綜合企業多元指數(美元避險)(Bloomberg Barclays Global Aggregate Corporates Diversified Index Hedged USD)為低的碳足跡提供長期總回報。自2020年1月13日起，本子基金不會投資涉及煙草生產或相關活動的公司。投資中國在岸固定收益證券包括但不限於以人民幣計價、在中華人民共和國(「中國」)境內發行及在中國銀行間債券市場買賣的在岸固定收益證券。本子基金可透過債券通及/或中國銀行間債券市場計劃投資於中國銀行間債券市場。本子基金可將其最多10%的淨資產投資於由(其中包括)市級及當地政府、公司及政策銀行發行的中國在岸債券。本子基金可將其淨資產最多10%投資於非投資級別固定收益證券。本子基金可將其淨資產最多10%投資於資產抵押證券及不動產抵押貸款證券。本子基金可將其淨資產最多10%投資於或有可轉換證券，惟預期不會超過5%。本子基金可透過將其淨資產最多10%投資於UCITS及/或其他合格UCIs(包括滙豐環球投資基金的其他子基金)的單位或股份，以達致其投資目標。本子基金可使用金融衍生工具作避險用途。本子基金亦可使用(惟不可廣泛使用)金融衍生工具作投資用途。本子基金獲准使用的金融衍生工具包括但不限於期貨、選擇權、交換(例如信貸違約交換)及外匯遠期(包括非可交付遠期)。金融衍生工具亦可嵌入於本子基金可投資的其他工具。本子基金的主要貨幣風險為美元。本子基金一般將貨幣與美元避險。本子基金亦可以輔助性質持有非美元貨幣(包括新興市場貨幣)資產(通常最多達其淨資產的10%)。(本基金對於特定資產投資限制詳見公開說明書內容)

## 參、投資本基金之主要風險

(詳細說明請參閱公開說明書中譯本第1.4節「一般風險因素」第3.3節「子基金的特定風險」)

本基金投資於新興市場(如中國)會使子基金承受較投資於已發展國家為高的市場風險。此乃由於(其中包括)與一般已發展市場相比，新興市場的波動性較大、成交量較低、政治及經濟不穩定、存在結算風險，市場閉關的風險較大，而政府對外商投資施加的限制亦較多。本基金可透過債券通及/或中國銀行間債券市場計劃投資於中國銀行間債券市場交易的債券。中國債券市場是由銀行間債券市場及交易所上市債

券市場組成。中國銀行間債券市場是場外交易市場，執行大部分中國境內債券交易。在中國銀行間債券市場交易的主要證券包括政府債券、央行票據、政策性銀行債券及企業債券。本基金或會將其淨資產投資於資產抵押證券（及／或不動產抵押貸款證券（包括待公佈證券）以對下列不動產抵押貸款證券進行投資：本基金可投資於構建成或有可轉換證券（包括額外的一級和二級資本工具）（亦稱為 CoCos）的或有證券。或有可轉換證券屬於具有風險且高度複雜的投資工具，相對較未經測試。根據其類別，發行人可能取消、暫停或延期收益付款，較股票更容易出現損失。或有可轉換證券是當發行人的資本跌至低於某一水平時會吸收損失的混合型資本證券。當發生預設事件（稱為觸發事件）時，或有可轉換證券可能按折讓價轉換為發行公司的股份，或所投資的本金可能會永久或暫時損失。境外基金係以外幣計價，投資人須承擔取得收益分配或買回價金時轉換回新臺幣可能產生之匯率風險。若轉換當時之新臺幣兌換外幣匯率相較於原始投資日之匯率升值時，投資人將承受匯兌損失。本基金不受存款保險、保險安定基金或其他相關保障機制之保障。故投資本基金可能發生部分或全部本金之損失，最大可能損失則為全部投資金額。

#### 肆、本基金適合之投資人屬性分析

本基金為債券型基金，主要投資於全球低碳足跡債券，本基金風險程度之等級為 RR2，適合非保守型投資人(依據「中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會基金風險報酬等級分類標準」)。此等級分類係基於一般市場狀況反映市場價格波動風險，無法涵蓋所有風險，不宜作為投資唯一依據，投資人仍應注意所投資基金個別的風險。本基金相關風險請參閱本文件「參、投資本基金之主要風險」或公開說明書中譯本之第 1.4 節「風險因素」定義、第 3.3 節「子基金特殊風險」。

#### 伍、基金運用狀況

一、基金淨資產組成：資料來源：滙豐環球投資管理(2020/9/30)

##### 1.依投資類別：

債券產業分佈	比重
金融機構債	43.25
通訊	8.36
能源	7.29
消費類，週期	6.63
消費類，非週期	6.31
公用事業	5.42
資訊科技	4.51
運輸品	3.90
資本貨	3.73
國庫券	3.03
其他行業	4.82
現金	2.73

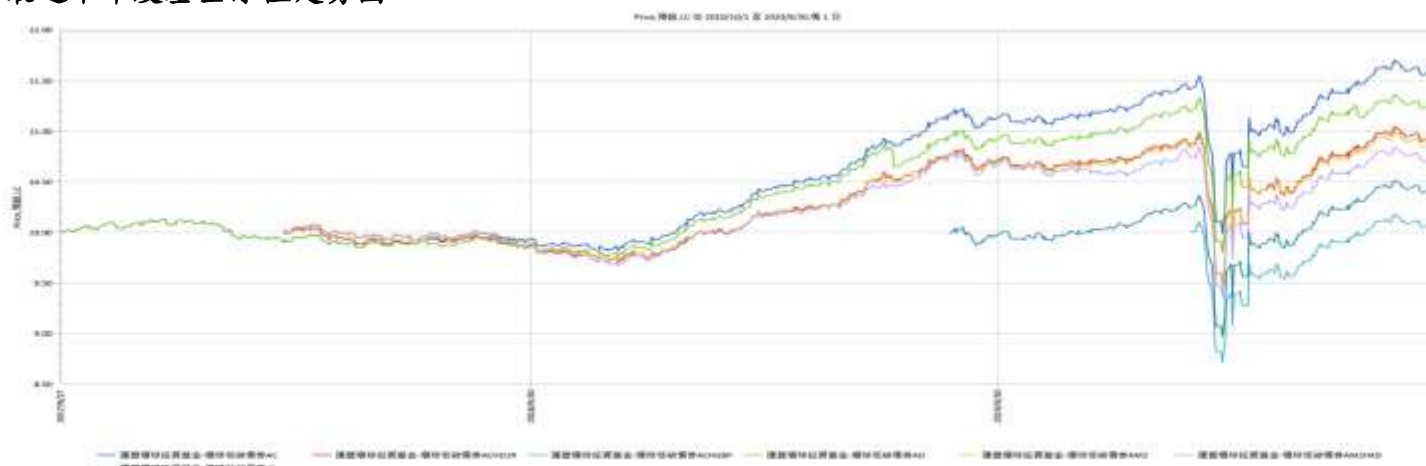
2.依投資國家或區域：資料來源：滙豐環球投資管理(2020/9/30)

股票國家分佈	比重	股票國家分佈	比重
美國	46.24	瑞士	3.77
法國	9.71	義大利	2.70
英國	8.77	西班牙	2.24
德國	7.96	愛爾蘭	1.59
加拿大	5.42	其他地區	4.72
荷蘭	4.16	現金	2.73

##### 3.固定收益投資標的信評：

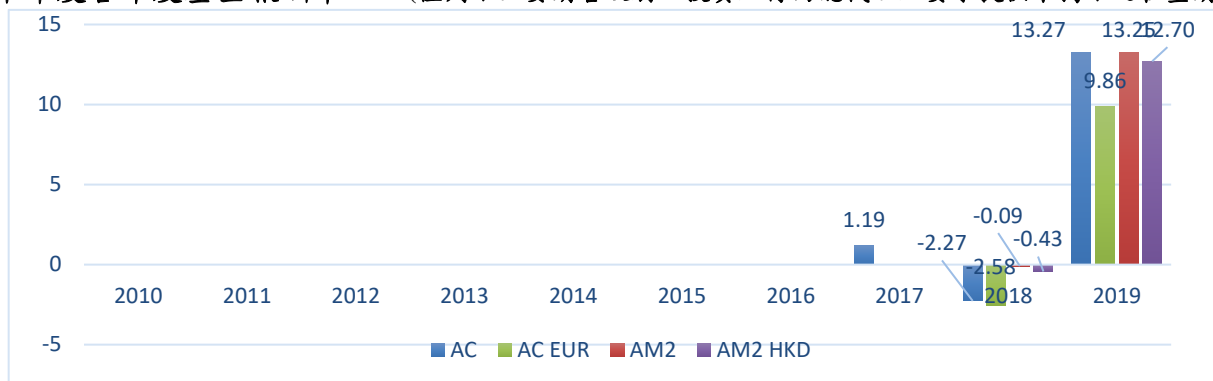
信用評等分佈	比重%	信用評等分佈	比重%
AAA	3.12	BB	1.43
AA	5.31	B	0.03
A	38.24	未評等	0.00
BBB	49.14	現金	2.73

#### 二、最近十年度基金淨值走勢圖：



資料來源：Lipper，2020/9/30(僅列示主要銷售級別，投資人得向總代理人要求提供未揭示之在臺銷售級別資訊)

三、最近十年度各年度基金報酬率%：(僅列示主要銷售級別，投資人得向總代理人要求提供未揭示之在臺銷售級別資訊)



資料來源：Lipper，2019/12/31，原幣計價。本基金 2017/9/27 成立，2017 年度報酬率為自成立日起來數值。

註：1.年度基金報酬率：指本基金淨資產價值，以 1~12 月完整曆年期間計算，加計收益分配後之累計報酬率。2.收益分配均假設再投資於本基金。

四、基金累計報酬率(%)：(僅列示主要銷售級別，投資人得向總代理人要求提供未揭示之在臺銷售級別資訊)

期 間	最近三個月	最近六個月	最近一年	最近三年	最近五年	最近十年	基金級別成立日 起算至資料日止	級別成立日
AC	1.08	7.03	3.72	15.40	NA	NA	15.46	2017/9/27
ACHEUR	0.86	6.50	1.66	NA	NA	NA	8.90	2018/3/20
AM2	1.07	7.03	3.71	NA	NA	NA	16.63	2018/3/21
AM2HKD	1.06	7.01	2.52	NA	NA	NA	15.05	2018/3/20

資料來源：Lipper，2020/9/30，原幣計價。註：1.累計報酬率：指至資料日期日止，本基金淨資產價值最近三個月、六個月、一年、三年、五年、十年及自基金成立日起算，加計收益分配之累計報酬率。2.收益分配均假設再投資於本基金。

備註\*：AC 與 IC 級別尚未有首次申購，因此無成立日期，須待類股首次申購時，本級別即開始計算淨值。

五、最近十年度各年度每受益權單位收益分配之金額/幣別：(在臺銷售之所有分配收益級別分別列示)

年度	2010	2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019
AD	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	0.058	0.143199
ADHEUR	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA
ADHGBP	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA
AM2	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	0.340865	0.32194
AM2HKD	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	0.043382	0.041026
AM3HAUD	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA
ID	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA

六、最近五年度各年度基金之費用率(%)：(在臺銷售之所有級別分別列示)

年度	2015	2016	2017	2018	2019	年度	2015	2016	2017	2018	2019
AC	NA	NA	1.03	1.05	1.05	AM2	NA	NA	1.03	1.05	1.05
AD	NA	NA	1.03	1.04	1.05	AM2HKD	NA	NA	1.03	1.08	1.05
ACHEUR	NA	NA	1.10	1.09	1.07	AM3HAUD	NA	NA	NA	NA	NA
ACHGBP	NA	NA	NA	NA	1.07	IC	NA	NA	NA	NA	0.60
ADHEUR	NA	NA	NA	NA	NA	ID	NA	NA	NA	NA	NA
ADHGBP	NA	NA	NA	NA	NA						

七、基金前十大投資標的及占基金淨資產價值之比率 資料來源：滙豐環球投資管理(2020/9/30)

基金前十大投資標的	比重%	基金前十大投資標的	比重%
1 NATL BANK CANADA 2.150 07/10/22	1.00	6 ING GROEP NV 4.625 06/01/26	0.69
2 COMCAST CORP 4.700 15/10/48	0.83	7 DEUTSCHE POST AG 0.750 20/05/29	0.63
3 US TREASURY N/B 0.625 15/08/30	0.79	8 EUROGRID GMBH 1.113 15/05/32	0.62
4 US TREASURY N/B 0.250 31/08/25	0.77	9 JPMORGAN CHASE 4.600	0.59
5 AIRCASTLE LTD 5.250 11/08/25	0.70	10 DELL INT / EMC 4.900 01/10/26	0.59

陸、投資人應負擔費用之項目及其計算方式(依公開說明書規定)

項目	計算方式或金額
----	---------

