

# 关于汇丰代客境外理财计划-开放式海外基金型产品所投资的霸菱东欧基金采用侧袋机制的通知

尊敬的客户，

接霸菱基金公司通知，我行代客境外理财计划-开放式海外基金型产品项下所投向的霸菱东欧基金（Baring Eastern Europe Fund）自2022年3月1日暂停该基金的赎回及暂停计算基金的单位资产净值以来，近期收到进一步通知：为应对此前的情况及增加基金的整体流动性，霸菱建议于2023年7月21日（生效日）采用侧袋机制，即将流动资产分离至新基金霸菱国际伞子基金——霸菱东欧基金（Barings International Umbrella Fund - Barings Eastern Europe Fund）并将非流动资产留存在基础基金霸菱环球伞子基金——霸菱东欧基金（Barings Global Umbrella Fund - Barings Eastern Europe Fund）中，具有流动性的新基金将在2023年7月24日开始交易。以上建议交易将通过特别大会形式予以最终确认，若有变化，我行亦将进一步告知。就此交易建议，我行特通知如下：

**1. 基金采用侧袋机制的背景和概况：**

此前根据霸菱基金公司通知，鉴于俄罗斯与乌克兰的情况所致的特殊和不利市况，基金公司于2022年3月1日暂停该基金的赎回，及根据香港发售文件暂停计算基金的单位资产净值。在暂停期间，持有人可继续提交赎回申请，但基金公司将不能处理有关申请直至暂停结束。为应对基金流动性受限的情况，基金公司于近期进一步通知，该基金建议于2023年7月21日（生效日）采用侧袋机制，将流动资产分离至新基金并将非流动资产留存在基础基金中。该安排被认为符合基础基金单位持有人的最佳利益，因其持有人能够恢复处理其在流动资产（将转移至新基金）中的权益（除受俄罗斯乌克兰事件影响的权益外），从而减轻基础基金持续暂停交易对基础基金单位持有人的影响。生效后，客户持有的基金会分成两部分，1）流动资产的部分放在新基金霸菱国际伞子基金——霸菱东欧基金（Barings International Umbrella Fund - Barings Eastern Europe Fund）中，原有ISIN代码迁移到新基金上；2）剩余非流动资产的部分仍然留存于基础基金霸菱环球伞子基金——霸菱东欧基金（Barings Global Umbrella Fund - Barings Eastern Europe Fund）中，并使用新的ISIN代码，且基金名字在生效日也会相应调整为霸菱东欧（侧袋机制）基金（Barings Eastern Europe (SP) Fund）。

**2. 对应汇丰代客境外理财计划-开放式海外基金型产品的具体情况如下：**

|             | 2023 年 7 月 21 日（生效日）前 | 2023 年 7 月 21 日（生效日）及以后 |                           |
|-------------|-----------------------|-------------------------|---------------------------|
| 基金名称        | 霸菱环球伞子基金——霸菱东欧基金-欧元   | 霸菱国际伞子基金——霸菱东欧基金-欧元     | 霸菱环球伞子基金——霸菱东欧（侧袋机制）基金-欧元 |
| 资产情况        | 全部资产                  | 流动资产                    | 非流动资产                     |
| 海外基金 ISIN 代 | IE0004852103          | IE0004852103            | IE000MQMMUD1              |

|      |                                      |                             |                 |
|------|--------------------------------------|-----------------------------|-----------------|
| 码    |                                      |                             |                 |
| 参考编号 | IPFD2015/IPFD3015                    | IPFD2015/IPFD3015           | 新代码             |
| 风险水平 | 5（最高风险）                              | 5（最高风险）                     | 5（最高风险）         |
| 交易状态 | 暂停申购或转入交易，我行接收赎回的提交申请，但是基金公司不能处理有关申请 | 仍然暂停申购或转入交易，7月24日起开放赎回或转出交易 | 暂停交易直至基金公司进一步通知 |

### 3. 基础基金与新基金的比较

**基金规模：**截至2022年2月28日，基础基金的基金规模为3.498亿美元。上述数据包括受影响资产价值减记为零之前的价值（受影响资产指的是俄罗斯与乌克兰目前情况导致对基础基金的俄罗斯、白俄罗斯和乌克兰资产的有序出售和估值受到影响）。截至2022年2月28日，受影响资产达基础基金资产净值的57.38%。截至2023年4月6日，受影响资产按照基础基金的组成文件和香港发售文件的估值规定被估值为零，其并不会构成交易的一部分。

新基金与基础基金具有相同的特征和风险概况以及相同的交易频次、交易截止时间、结算限期、资产净值计算及分派/股息政策。基础基金及新基金的费用结构相同。

### 4. 采用侧袋机制的具体影响

**交换比率：**根据交易条款，基础基金持有人将于生效日期于新基金中获发行同等数量的新单位，价值等于其所持现有单位的价值（其目前不包括受影响资产的价值，因为有关资产目前的估值为零），并继续于基础基金持有与生效日前持有数量相同的单位。即，于生效日期，向各基础基金单位持有人发行的新单位数目将使用交换比率1: 1计算。

**基础基金后续运营：**交易生效后，基础基金将维持运营并继续持有受影响资产。基金经理将提供最新消息及知会基础基金单位持有人任何有关基础基金地重大进展。

**资产净值：**基础基金的官方资产净值和新基金的实际资产净值将到生效日期方能知道。

**生效后首个交易日：**新单位的交易获准在生效日后新基金的首个交易日即2023年7月24日进行。

**交易开支：**交易附带的所有成本将由基金经理承担，包括法律、咨询、行政管理费用以及基础资金转移流动资产至新基金附带的成本。自基础基金暂停日至生效日，仅就流动资产部分收取管理费。交易生效后，基础基金将豁免缴付管理费。

### 5. 可供查阅的文件

详细内容请参阅霸菱官网：<https://www.barings.com/zh-hk/individual/funds/public-equities/barings-eastern-europe-fund>

**重要提示：**

我行提供以上信息并非也不应被视为关于投资、持有或赎回任何产品的建议。投资有风险，过往表现不代表也不预示将来表现。您可根据您的个人情况（包括但不限于，您的风险偏好、投资经验、投资目标和财务状况等），考虑和自行决定持有相关代客境外理财产品或是适时选择赎回。您若有任何疑问或者希望了解更详细的信息，您可随时垂询您的客户经理。

谢谢！

汇丰银行（中国）有限公司

2023年4月10日