

重要提示：本函件乃重要文件，務須閣下即時處理。倘若閣下對本函件的内容有任何疑問，應徵詢獨立專業意見。

**AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l.**  
*Société à responsabilité limitée*  
2-4, rue Eugène Ruppert  
L-2453 Luxembourg  
R.C.S. Luxembourg B 34 405

以其本身名義但代表以下傘子基金行事

**AB FCP I**  
*Fonds Commun de Placement*  
R.C.S. Luxembourg: K217

致以下基金股東的通知  
**AB FCP I – 中國低波幅策略股票基金**  
**AB FCP I – 全方位領航基金**  
**AB FCP I – 日本策略價值基金**  
**AB FCP I – 按揭收益基金**  
**AB FCP I – 短期債券基金**  
(各稱及統稱為「基金」)

2021年11月15日

除非另有指明，否則本通知中所用詞彙具有與日期為2021年7月15日的AB FCP I認購章程（「認購章程」，經不時修訂）中所概述者相同的涵義。

尊貴的股東：

本函件旨在通知閣下，擔任AB FCP I（根據盧森堡大公國法律組成的互惠投資基金（*fonds commun de placement*）（「本傘子基金」）的管理公司AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l.（「管理公司」）的管理會（「管理會」）已決定作出下列更改：

## 1) 中國交易

### **AB FCP I – 中國低波幅策略股票基金的中國A股總持倉限制的變動**

管理會已決定，自2022年1月1日（「生效日期」）起，將基金可透過能夠進入中國市場的一個或多個資本市場制度（包括中華通、管理公司或聯屬公司所持有的RQFII額度，及／或透過獲金融業監管委員會（*Commission de Surveillance du Secteur Financier*）批准可能不時推出的其他制度）投資中國A股的總持倉限制，從「少於其資產淨值的30%」增加至「最多達其資產淨值的40%」。為免生疑問，基金的投資目標將不會更改。

管理會認為，中國A股持倉限制有所增加將使投資經理能靈活提高基金對上市中國證券的持倉，這將令投資經理能夠更有效及高效地實行基金的投資目標。

投資者應注意，由於中國A股持倉增加，基金面臨透過有關資本市場制度投資中國A股的相關現有風險水平將有所增加，該等風險載於香港發售文件（「香港發售文件」），並詳述於下文以方便參考：

- 透過RQFII作出投資的相關風險（相關風險因素將易名為「國家風險 - 中國 - FII」） - 基金作出相關投資或全面實行或達致其投資目標及策略的能力須受中國的適用法律、規則及規例

(包括投資及匯回本金和利潤的限制)所規限,該等法律、規則及規例可能會變更,而有關變更可能具有潛在追溯效力。如果基金獲分配的RQFII額度不足,RQFII的批准被撤銷/終止或以其他方式失效,而基金可能被禁止買賣相關證券及匯回基金的資金,或如果任何主要運作方或參與方(包括RQFII託管人/經紀)破產/違約及/或喪失履行其義務(包括執行或結算任何交易或轉帳或轉讓證券)的資格,則基金可能遭受重大損失。

- **中國股票風險 – 中華通 (相關風險因素將易名為「國家風險 - 中國 – 中華通」)** – 中華通須受中國內地及香港的監管當局頒布的規例及證券交易所制定的實施規則所規限。相關規則及規例可能會作出具有潛在追溯效力的變更。概不能保證透過中華通買賣中國A股(「**中華通證券**」)將形成或維持活躍的交易市場。若中華通證券的差價大,這可能會對基金按理想價格出售中華通證券的能力造成不利影響。若本基金需要在不存在活躍市場時出售中華通證券,其就中華通證券收取的價格(假設能夠將之出售)可能低於若存在活躍市場時收取的價格。

根據中華通進行交易將受每日額度所限,這可能限制基金透過中華通及時投資於中華通證券的能力。若透過中華通進行交易被暫停,基金透過中華通投資於中國A股的能力將受到不利影響。在該情況下,基金達致其投資目標的能力將受到負面影響。

- **中國稅務風險 – 有關基金通過RQFII額度或中華通或連接產品在中國進行投資而變現的資本收益的現行中國稅務法律、規例及慣例存在風險及不確定性(可能具追溯效力)。**基金稅務責任如有任何增加,可能對基金的價值造成不利影響。基金現時並無任何稅項撥備。

與本傘子基金的香港發售文件的更改及更新相關的開支(包括備製及印刷經修訂香港發售文件的成本,以及上述事項的法律費用)約為18,000美元,將由基金承擔。

#### **AB FCP I – 短期債券基金運用債券通**

自生效日期起,AB FCP I – 短期債券基金在尋求達致其投資目標時,可將其少於30%的資產淨值,透過債券通投資於中國債務證券,惟須受香港發售文件所概述的任何現有投資限制所規限。債券通為基金提供一個更有效率的方式投資於中國債務證券。

因此,基金的投資政策將予更新以包括有關債券通的披露。更多有關中國買賣准入點及相應風險的資料可參閱香港發售文件。

為免生疑問,以上變動並不影響基金現時的管理方式,亦不改變其投資目標。

## **2) 基準的變更**

由於倫敦銀行同業拆息利率(LIBOR)於2021年年底退出,自生效日期起,本傘子基金的下述基金用於業績比較的基準將變更如下:

基金	目前的基準	新基準
全方位領航基金	3個月倫敦銀行同業拆息利率	具抵押隔夜融資利率(SOFR)
按揭收益基金	3個月倫敦銀行同業拆息利率(美元)	具抵押隔夜融資利率(SOFR)

為免生疑問,基準的變更並不影響基金現有的管理方式。所有基金維持主動式管理,基準的變更並不改變相關基金的投資目標、政策或策略。此外,目前的基準及新基準均不用於計算任何費用。

## **3) 日本策略價值基金的自願性開支上限的更新**

管理公司已決定,為了符合股東的最佳利益,自願將某財政年度對某特定股份類別的投資者收取的總費用及成本總額之上限降低。自願性開支上限將更新如下:

股份類別 <sup>1</sup>	先前的自願性開支上限	新的自願性開支上限
A	2.15%	1.70%
I	1.35%	0.90%

此項變更將於生效日期起生效。

\* \* \*

### 上述變更的影響

基金的營運及／或管理方式將無任何變動。除上文所述外，適用於基金的特點及風險將無任何變動。此外，管理基金的費用水平／成本將無任何變動，而有關變更亦不會損害基金現有股東的權利或權益。

**其他投資選擇。**管理會認為，上述各項變更符合股東的最佳利益。如果閣下有不同意見，於有關變更生效前有多個選項可供閣下選擇：(1) 閣下可要求將閣下投資的相關基金股份免費轉換為香港證監會認可<sup>2</sup>並可透過聯博授權的分銷商在香港進行零售分銷的另一隻聯博保薦基金的同等股份／單位類別；或(2) 閣下可免費贖回閣下於相關基金中的股份（須繳付或有遞延銷售費（如適用於閣下的股份））。為免生疑問，分銷商收取的任何費用仍可能適用。

### 可供查閱文件

香港發售文件（包括認購章程、致香港投資者補充資料及各基金的產品資料概要），將予修訂以反映上述變更。經修訂香港發售文件的副本，可按下文「聯絡資料」一節聯絡閣下的財務顧問、聯博投資者服務部服務中心或聯博香港有限公司免費索取。

### 聯絡資料

**如何索取更多資料。**如閣下對本函件的内容有任何疑問，請聯絡閣下的財務顧問或聯博投資者服務部服務中心的客戶服務分析員：

歐洲／中東 +800 2263 8637或+352 46 39 36 151（歐洲中部時間上午九時正至下午六時正）。

亞太區 +800 2263 8637或+65 62 30 2600（新加坡標準時間上午九時正至下午六時正）。

美洲 +800 2263 8637或+800 947 2898或+1 212 823 7061（美國東部時間上午八時三十分至下午五時正）。

此外，閣下可聯絡聯博香港有限公司（作為本傘子基金的香港代表），地址為香港鰂魚涌華蘭路18號太古坊港島東中心39樓，或致電+852 2918 7888。

管理會對本函件內容的準確性承擔責任。

### AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l.管理會

謹啟

<sup>1</sup> 該扣減或自願性開支上限的實施適用於相應的貨幣對沖及貨幣計價股份類別。

<sup>2</sup> 證監會認可並非推薦或認許基金，亦不保證基金的商業利弊或其表現。這並不意味基金適合所有投資者，亦並非認許其適合任何特定投資者或投資者類別。