

本概要提供本基金的重要資料。
本概要是發售文件的一部分。
請勿單憑本概要作投資決定。

資料便覽

管理公司：	Robeco Institutional Asset Management B.V.
存管處：	J.P. Morgan SE, Luxembourg Branch
全年經常性開支比率：	D 類美元：1.41% [±]
交易頻率：	每日
基本貨幣：	美元
股息政策：	D 類－股息（如有）將作再投資用途。不會分派股息。
本基金財政年度終結日：	12 月 31 日
最低投資額：	<u>最低首次投資額</u> D 類：1 股

其後投資額

無

[±]由於股份類別為新設立的股份類別，數據僅為預估，代表預估可向子基金相關股份類別收取的經常性開支，以子基金平均資產淨值的百分比表示。實際數字可能有所不同，並可能每年有所變動。

本基金是甚麼產品？

子基金是荷寶資本成長基金的子基金。荷寶資本成長基金是一家在盧森堡註冊成立的可變資本開放式投資公司，其主管監管機構為盧森堡金融業監察委員會（Commission de Surveillance du Secteur Financier，簡稱「CSSF」）。

子基金名稱中「QI」一詞指「量化投資」，即表示子基金屬於荷寶量化管理基金系列。

目標及投資策略

目標

子基金的目標是實現長期資本增長，同時透過促進若干 ESG（即環境、社會及企業管治）特徵，並將可持續發展風險納入投資流程，力求達致優於 MSCI 新興市場指數（「基準」）的可持續發展特性。

為免生疑問，根據證券及期貨事務監察委員會於 2021 年 6 月 29 日刊發的《致證監會認可單位信託及互惠基金的管理公司的通函》（經不時修訂），子基金並不構成綠色／ESG 基金。

策略

子基金將其總資產最少三分之二投資於在新興國家註冊成立，或在新興國家開展其主要經濟活動之公司的股票。新興國家一般指經濟發展較不成熟及／或金融市場發展尚未完善且經濟增長潛力較高的國家，包括亞洲、拉丁美洲、東歐、中東及非洲的大多數地區／市場（包括但不限於中國、中國台灣、南韓、印度、巴西及南非）。新興及發展較不成熟市場的名單乃根據基準釐定，可能發生變更，並由管理公司不時檢討。

子基金可投資於任何經濟行業及任何貨幣，且選擇投資企業時不受其規模限制。

子基金採用積極管理策略，並將應用荷寶的 3D 投資方針（詳見基金說明書「定義詞彙表」），此方針旨在於子基金投資組合中兼顧風險、回報及可持續發展。子基金投資組合將運用量化流程

進行優化，力求取得高於基準的回報、實現優於基準的可持續發展特徵，同時管理相對基準的風險。投資組合層面的所有決策均以投資組合建構演算法的設定為基礎，該演算法考慮風險、回報及可持續發展，並根據股票在荷寶專有量化股票排名模型中的評分識別估值偏低及估值偏高的股票。

子基金以基準作資產配置用途。子基金運用量化選股策略，根據股票的預期未來相對表現進行排名，所用策略包括：聚焦估值吸引的股票（價值）的策略；聚焦中期表現趨勢吸引的公司股票（動量）的策略；以及聚焦優質股票，例如資產負債表穩健且盈利能力高的公司股票（質素）的策略。子基金投資範圍所選證券可為基準的成分證券，亦可選取基準以外的證券。子基金可偏離基準的權重。管理公司可根據投資目標自行配置投資組合，對排名較高的股票持相對基準偏高比重，並對排名較低的股票持相對偏低比重，從而建構充分多元化的投資組合。子基金根據市值及成交量，從約700項流通性高且交易成本較低的新興市場股票中選出最具吸引力的股票。子基金旨在長期跑贏基準，同時透過對持倉偏離基準的程度應用限制，以控制風險。

該基準屬廣泛市場加權指數，並不符合子基金所促進的環境、社會及管治特徵。

在全面考慮投資限制及在適用法例許可的情況下，子基金可投資於股票、可換股債券、債券、UCITS及／或其他UCI單位及衍生工具，以實現子基金投資目標。

子基金獲准為資金管理目的及於市況不利時，將其淨資產最多33%投資於貨幣市場工具、銀行存款（即期存款除外）及其他合資格流動資產。

子基金可將其淨資產最多20%持有輔助流動資產（即期銀行存款，如往來賬戶持有的現金）。在極端不利市況下，且在顧及股東利益後理據充份時，子基金可暫時超出上述輔助流動資產及其他流動工具的投資限額。

就投資於在中國上市的中華人民共和國（「中國」）公司股份之目的而言，子基金可將其淨資產最多30%投資於由中國公司發行並在中國證券交易所上市的中國A股（透過QFI及／或滬深港通計劃）及中國B股。若子基金擬投資多於其淨資產的30%於中國A股及中國B股，將向投資者發出最少一個月事先通知，並相應地更新基金說明書。

可使用交易所買賣的衍生工具及場外衍生工具，包括但不限於期貨、掉期、期權、遠期貨合約及／或上述工具之組合。

投資者應注意，子基金可從事回購協議（其資產淨值最多 10%）、反向回購協議（其資產淨值最多 15%）及證券借貸交易（其資產淨值最多 49%）。

子基金促進 2019 年 11 月 27 日有關金融服務業可持續發展相關披露的規例(EU) 2019/2088 第 8 條所定義的環境及／或社會特徵。子基金力求創造經濟收益，同時考慮環境、社會及管治特徵（詳見基金說明書附件 VIII）。

使用衍生工具／投資於衍生工具

子基金的衍生工具風險承擔淨額最高可達子基金資產淨值的 50%。

本基金有哪些主要風險？

投資涉及風險。請參閱發售文件，以了解風險因素等資料。

- **一般投資風險**－子基金投資組合的價值可能會因以下任何一項主要風險因素而下跌，因此，閣下於子基金的投資可能會蒙受損失。概不保證可獲償還本金。
- **股票投資風險**－股票證券承受市場價值可升可跌的風險。該等股票證券的價格可能波動。特別是，若子基金所投資的股票證券市場價值下跌，投資者可能蒙受重大損失。
- **市場風險**－股份價值對整體市場波動，以及特別對股票證券價格及其他個別金融工具的價格波動敏感。此外，投資者應注意，投資價值可能因投資氣氛、政治、經濟或市場環境的變

動，以及個別業務情況的變動而改變，因此不能保證子基金的價值不會跌至低於購入時的價值。

- **集中風險**－子基金可根據其投資政策投資於（主要）在同一行業及／或國家營運的發行機構所發行的金融工具。在該情況下，由於子基金的投資組合集中，影響該等發行機構的事件對子基金資產的影響，可能高於集中度較低的投資組合。
- **新興市場風險**－在子基金可能投資的若干新興及發展尚未成熟的市場，法律、司法及監管架構仍在發展中，故當地市場參與者及其海外對手方均面對不明朗的法律因素。投資於該等市場可能涉及額外風險，包括社會、政治及經濟狀況不穩定、外匯管制、會計及稅務問題、法令和法例的詮釋及應用不明確、託管和結算系統發展欠完善等。
- **貨幣風險**－子基金的全部或部分證券組合，均可投資於以子基金基本貨幣以外之貨幣計價的工具。此外，股份類別亦可指定以子基金基本貨幣之外的貨幣計價。因此，所持資產計價貨幣與子基金基本貨幣及／或相關類別貨幣之間的匯率波動，可能導致子基金蒙受損失。

貨幣風險可能已對沖，但投資者應注意，概不保證所投資股份計價貨幣的風險已全面或有效對沖子基金的基本貨幣。貨幣風險可透過遠期貨幣交易及貨幣期權對沖。若對沖貨幣風險的措施未能發揮預期成效，子基金可能因進行對沖而蒙受損失。

投資者亦應注意，在個別情況下，運用貨幣工具可能顯著削弱相關股份類別的股東權益（例如：若基本貨幣兌子基金所投資的工具貨幣貶值）及因而降低持股價值。

- **中國 A 股風險**－子基金可能透過 QFI 及／或滬深港通計劃投資於中國 A 股，可能涉及額外的結算及交收風險、監管風險、操作風險及對手方風險。

子基金進行相關投資或全面實施或達成投資目標及策略的能力，須受中國適用法律、規則及規例（包括對投資、本金和利潤匯回的限制）所規限，該等法律、規則及規例可能改變，並可能具有追溯效力。由於交易以免付款方式且僅透過每個市場的單一經紀進行，故產生結算及交收風險以及對手方風險。

滬深港通計劃的相關規則及規例可能改變，並可能具有追溯效力。滬深港通計劃須受額度限制約束。倘透過該等計劃進行的交易暫停，子基金透過該等計劃投資於中國 A 股或參與中國市場的能力將受到不利影響。在此情況下，子基金達成其投資目標的能力可能受到負面影響。

- **投資於金融衍生工具的風險**－子基金的投資組合可能包括為有效投資組合管理、投資目的或試圖對沖及降低整體投資風險而使用的金融衍生工具。投資金融衍生工具的相關風險包括對手方／信貸風險、流動性風險、估值風險、波幅風險及場外交易風險。金融衍生工具的槓桿元素／成份可能導致子基金所蒙受的損失顯著高於其投資於該金融衍生工具的金額。投資於金融衍生工具可能使子基金面臨重大損失的高風險。
- **流動性風險**－子基金投資金融工具的實際買賣價格部分取決於相關金融工具的流動性。代表子基金持有的倉盤可能因市場供求缺乏流動性或該等金融工具認購／贖回款項支付出現延遲，而無法在適當時機以合理價格變現。此情況可能導致股份的認購或贖回出現延遲、暫停或受限，及／或可能導致子基金蒙受損失。
- **與證券借貸相關的風險**－就證券借貸交易而言，子基金面對的風險是收受人士無法履行其責任於議定日期交還借出的證券或提供所要求的額外抵押品（若現有抵押品的價值跌至低於所借出證券的價值），因此，子基金可能蒙受損失，其資產淨值亦可能遭受不利影響。

子基金表現如何？

由於在香港向零售投資者發售的股份類別為新設立，因此數據不足以向投資者提供有用的過往表現指標。

本基金有否提供保證？

子基金並不提供任何保證。閣下未必能取回全數投資金額。

投資本基金涉及哪些費用及收費？

閣下或須繳付的收費

閣下或須就子基金股份交易繳付以下費用。

費用

認購費（銷售費用）

額外費用[#]

轉換費

贖回費

金額

不多於認購額的 5%

不多於認購額的 3%

不多於轉換總額的 1%

無

[#]董事可基於現有股東的最佳利益決定於任何特定時期向本子基金的任何特定（或所有）股份類別徵收不多於認購額 3% 的額外費用。任何該等額外費用將為本子基金的直接利益，即其現有股東的間接利益。

子基金持續繳付的費用

以下收費將從子基金中扣除，閣下的投資回報將會因而減少。

管理費*	每年收費率（佔子基金價值百分比）	
	股份類別	管理費
	D 類美元	1.15%
表現費	不適用	
行政費**（服務費）	股份類別	服務費
	D 類美元	0.20%

其他費用

閣下或須就子基金股份交易繳付其他費用。

*每年最高管理費率為 1.15%。目前費率如有任何調高，將給予受影響股東最少一個月事先通知，如需監管批准，須待批准後才生效。

**某子基金相關股份類別應付相等於相關股份類別每月平均資產淨值（按收市價計算）年率最高 0.26% 的服務年費。倘某子基金的管理資產超過 35 億歐元，適用於相關股份類別的當前服務費率將就超出此限額的資產享有 0.02% 折扣，而子基金資產每再增加 20 億歐元，服務費率將進一步享有 0.02% 折扣。然而，就特定股份類別而言，服務年費費率不得低於 0.01%。

其他資料

- 股份類別申請或股份轉換或贖回要求，將按截至估值日¹子基金的每股資產淨值處理，前提是 J.P. Morgan SE, Luxembourg Branch（作為行政代理）在當日下午 3 時正（歐洲中部時間）或之前收妥該等申請或要求。就透過香港認可分銷商送交的申請或贖回要求而言，香港投資者應注意，香港認可分銷商可能設定較早的截止時間。
- 子基金（每類別）股份的資產淨值將每天於 www.robeco.com.hk 公布。此網站未經證監會審閱或認可。

重要提示

閣下如有疑問，應諮詢專業意見。

證監會對本概要的內容並不承擔任何責任，對其準確性或完整性亦不作出任何陳述。

¹ 估值日是指子基金接納交易要求及計算各股份類別每股資產淨值的日子。