

宏利投資管理（香港）有限公司管理及營運的基金的氣候指標披露

簡介

宏利投資管理香港有限公司（「宏利投資管理（香港）」）認為，氣候變化是系統性風險，可能對全球經濟、資本市場及整個社會造成迫切且有可能無法逆轉的影響。這些影響將在幾乎所有行業的所有公司的風險及機會上顯露出來，因此投資者必須正確評估，以保護客戶的資產。

作為管治其氣候相關風險管理的框架之一環，宏利投資管理（香港）會監控可持續發展風險以及與投資相關及重大的因素，包括氣候相關風險。投資組合碳足跡被視為評估由宏利投資管理（香港）管理及營運的基金的氣候相關風險的重要指標。

投資組合碳足跡

投資組合碳足跡反映了按投資組合市值進行歸一化的碳排放量，以每百萬美元投資產生的二氧化碳當量（CO₂e）噸數列示。以下是計算投資組合碳足跡的公式¹：

$$\sum_{i=1}^N \left(\frac{\text{投資現值 } i}{\text{被投資公司企業價值 } i} \times \frac{\text{被投資公司的範圍一及範圍二溫室氣體排放量 } i}{\text{投資組合現值（百萬美元）}} \right)$$

宏利投資管理（香港）管理及營運的基金根據以上公式計算的投資組合碳足跡在以下列表呈列。

有關宏利投資管理（香港）的可持續發展方針（包括氣候相關風險）的進一步資料，請參閱[可持續發展](http://manulifefunds.com.hk)（manulifefunds.com.hk）。

¹[致持牌法團的通函](#)

[基金經理對氣候相關風險的管理及披露](#)

宏利投資管理（香港）管理及營運的基金的投資組合碳足跡

基金	碳足跡 (二氧化碳當量 (噸 CO ₂ e) / 每百萬美元投資)	數據範圍	截至財政年度結束 的數據
ManuFlex (MIL)			
進取基金*	73.51	93.16%	2023 年 12 月 31 日
均衡基金*	76.77	80.15%	2023 年 12 月 31 日
資金保證基金(港元)*	35.02	64.23%	2023 年 12 月 31 日
資金保證基金(美元)*	362.89	50.71%	2023 年 12 月 31 日
中華威力基金*	56.17	100.00%	2023 年 12 月 31 日
歐洲股票投資基金*	8.95	91.25%	2023 年 12 月 31 日
五年定期儲蓄基金**	不適用	低於 50%	2023 年 12 月 31 日
康健護理基金*	3.56	92.94%	2023 年 12 月 31 日
香港股票投資基金*	118.53	99.59%	2023 年 12 月 31 日
國際債券基金**	不適用	低於 50%	2023 年 12 月 31 日
國際股票投資基金*	35.54	96.54%	2023 年 12 月 31 日
日本股票投資基金*	34.73	100.00%	2023 年 12 月 31 日
摩根環球債券基金*	129.65	69.19%	2023 年 12 月 31 日
北美股票投資基金*	18.11	96.87%	2023 年 12 月 31 日
亞太股票投資基金*	158.56	95.34%	2023 年 12 月 31 日
施羅德組合投資基金*	36.24	86.13%	2023 年 12 月 31 日
穩健基金*	99.43	72.41%	2023 年 12 月 31 日
科技基金*	5.96	98.57%	2023 年 12 月 31 日
美國股票策略投資基金*	10.22	99.06%	2023 年 12 月 31 日
恒指基金**	不適用	不適用	2023 年 12 月 31 日
Manuflex			
均衡基金*	76.77	80.15%	2023 年 12 月 31 日
資金保證基金(港元)*	35.02	64.23%	2023 年 12 月 31 日
歐洲股票投資基金*	8.95	91.25%	2023 年 12 月 31 日
五年定期儲蓄基金**	不適用	低於 50%	2023 年 12 月 31 日
香港股票投資基金*	118.53	99.59%	2023 年 12 月 31 日
國際債券基金**	不適用	低於 50%	2023 年 12 月 31 日
國際股票投資基金*	35.54	96.54%	2023 年 12 月 31 日

日本股票投資基金*	34.73	100.00%	2023年12月31日
北美股票投資基金*	18.11	96.87%	2023年12月31日
亞太股票投資基金*	158.56	95.34%	2023年12月31日
ManuFund (MIL)			
資金保證基金(港元)*	35.02	64.23%	2023年12月31日
Manufund			
資金保證基金(港元)*	35.02	64.23%	2023年12月31日
五年定期儲蓄基金**	不適用	低於 50%	2023年12月31日
團體儲蓄管理計劃(MIL)			
資金保證基金(港元)*	35.02	64.23%	2023年12月31日
國際股票投資基金*	35.54	96.54%	2023年12月31日
團體儲蓄管理計劃			
資金保證基金(港元)*	35.02	64.23%	2023年12月31日
資金保證基金(美元)*	362.89	50.71%	2023年12月31日
十五年定期儲蓄基金**	不適用	低於 50%	2023年12月31日
五年定期儲蓄基金**	不適用	低於 50%	2023年12月31日
國際股票投資基金*	35.54	96.54%	2023年12月31日
Manulife Investment Trust			
Strategic Income Fund**^†	不適用	低於 50%	2023年12月31日
Global Semiconductor Equity Fund**^	22.01	98.12%	2023年12月31日
Strategic Income Opportunities Fund**^†	不適用	低於 50%	2023年12月31日
Global Allocation Fund II**^	63.56	52.42%	2023年12月31日
US Core Fixed Income Fund**^†	不適用	低於 50%	2023年12月31日
宏利(澳門)退休金計劃			
均衡基金(澳門)**^	81.64	67.70%	2023年12月31日
保證基金(澳門)**^	113.44	65.08%	2023年12月31日
康健護理基金(澳門)**^	33.31	84.16%	2023年12月31日
中港股票基金(澳門)**^	118.23	88.24%	2023年12月31日
亞太債券基金(澳門)**^	32.05	52.39%	2023年12月31日
平穩增長基金(澳門)**^	89.80	56.65%	2023年12月31日
宏利環球精選(強積金)計劃			
宏利 MPF 2025 退休基金*	88.65	80.57%	2024年3月31日
宏利 MPF 2030 退休基金*	88.32	83.61%	2024年3月31日
宏利 MPF 2035 退休基金*	87.51	87.57%	2024年3月31日
宏利 MPF 2040 退休基金*	87.25	93.57%	2024年3月31日

宏利 MPF 2045 退休基金*	88.60	93.36%	2024 年 3 月 31 日
宏利 MPF 65 歲後基金**	不適用	不適用	2024 年 3 月 31 日
宏利 MPF 進取基金*	72.28	89.44%	2024 年 3 月 31 日
宏利 MPF 中華威力基金*	80.75	98.25%	2024 年 3 月 31 日
宏利 MPF 保守基金**	不適用	低於 50%	2024 年 3 月 31 日
宏利 MPF 核心累積基金**	不適用	不適用	2024 年 3 月 31 日
宏利 MPF 歐洲股票基金*	8.33	96.89%	2024 年 3 月 31 日
宏利 MPF 富達增長基金*	80.10	65.00%	2024 年 3 月 31 日
宏利 MPF 富達平穩增長基金**	不適用	低於 50%	2024 年 3 月 31 日
宏利 MPF 增長基金*	73.61	78.58%	2024 年 3 月 31 日
宏利 MPF 恒指 ESG 基金**	49.90	100.00%	2024 年 3 月 31 日
宏利 MPF 康健護理基金*	3.31	95.42%	2024 年 3 月 31 日
宏利 MPF 香港債券基金*	106.69	74.55%	2024 年 3 月 31 日
宏利 MPF 香港股票基金*	108.20	98.71%	2024 年 3 月 31 日
宏利 MPF 利息基金*	77.39	75.72%	2024 年 3 月 31 日
宏利 MPF 國際債券基金**	不適用	低於 50%	2024 年 3 月 31 日
宏利 MPF 國際股票基金*	47.00	95.32%	2024 年 3 月 31 日
宏利 MPF 日本股票基金*	34.43	91.61%	2024 年 3 月 31 日
宏利 MPF 北美股票基金*	31.58	98.69%	2024 年 3 月 31 日
宏利 MPF 可持續亞太債券基金*	35.44	66.92%	2024 年 3 月 31 日
宏利 MPF 亞太股票基金*	165.74	93.86%	2024 年 3 月 31 日
宏利 MPF 退休收益基金*	87.43	76.28%	2024 年 3 月 31 日
宏利 MPF 人民幣債券基金*	39.96	56.30%	2024 年 3 月 31 日
宏利 MPF 智優裕退休基金*	90.43	79.19%	2024 年 3 月 31 日
宏利 MPF 穩健基金*	91.67	78.72%	2024 年 3 月 31 日

Manulife Provident Fund Unit Trust Series

Manulife China A Equity Fund*	147.46	93.34%	2024 年 3 月 31 日
Manulife China Value Fund*	48.71	98.62%	2024 年 3 月 31 日
Manulife China Value Fund Series - (I)*	149.94	96.89%	2024 年 3 月 31 日
Manulife China Value Fund Series - (II)*	41.35	99.33%	2024 年 3 月 31 日
Manulife Conservative Fund**	不適用	低於 50%	2024 年 3 月 31 日
Manulife European Equity Fund*	8.33	97.52%	2024 年 3 月 31 日
Manulife European Equity Fund Series - (I)*	58.57	95.76%	2024 年 3 月 31 日
Manulife Global Investment Grade Bond Fund*	92.46	86.52%	2024 年 3 月 31 日
Manulife Healthcare Fund*	3.46	95.89%	2024 年 3 月 31 日

Manulife Healthcare Fund Series - (I)*	2.61	92.38%	2024年3月31日
Manulife Healthcare Fund Series - (II)*	3.30	96.29%	2024年3月31日
Manulife Hong Kong Equity Fund*	125.04	98.78%	2024年3月31日
Manulife Hong Kong Equity Fund Series - (I)*	99.72	96.87%	2024年3月31日
Manulife Hong Kong Medium Term Bond Fund*	106.69	74.55%	2024年3月31日
Manulife Hong Kong Short Term Bond Fund*	57.12	74.89%	2024年3月31日
Manulife International Bond Fund**†	不適用	低於 50%	2024年3月31日
Manulife Japan Equity Fund*	34.43	91.82%	2024年3月31日
Manulife North American Equity Fund*	19.96	99.02%	2024年3月31日
Manulife North American Equity Fund Series - (I)*	12.97	99.06%	2024年3月31日
Manulife North American Equity Fund Series - (II)*	77.76	97.39%	2024年3月31日
Manulife Sustainable Pacific Asia Bond Fund*	35.44	66.89%	2024年3月31日
Manulife Pacific Asia Equity Fund*	174.96	93.44%	2024年3月31日
Manulife RMB Bond Fund*	24.43	53.62%	2024年3月31日
Manulife Technology Fund*	6.89	99.43%	2024年3月31日
保單			
利息基金保單*	76.64	75.72%	2024年3月31日
穩健基金保單*	91.12	78.72%	2024年3月31日
宏利資產分佈基金			
宏利平衡基金*	75.87	79.77%	2024年3月31日
宏利增長基金*	72.70	91.21%	2024年3月31日
宏利穩定基金*	76.33	64.12%	2024年3月31日
其他			
宏利在職平均回報保證基金*	224.34	75.74%	2024年3月31日
宏利盈進基金 SPC			
中國 A 股獨立資產組合	383.18	94.24%	2024年6月30日
預定回報獨立資產組合 I#	不適用	不適用	2024年6月30日
大灣區增長及收益獨立資產組合	195.39	86.89%	2024年6月30日
人民幣債券獨立資產組合†	不適用	低於 50%	2024年6月30日
美國銀行業股票獨立資產組合	0.81	97.46%	2024年6月30日
宏利環球基金			
東協股票基金	61.99	94.92%	2024年6月30日
亞洲動力入息基金	181.83	84.37%	2024年6月30日
亞太房地產投資信託產業基金	7.91	99.07%	2024年6月30日

亞洲總回報基金†	不適用	低於 50%	2024 年 6 月 30 日
亞洲高收益基金	290.32	76.46%	2024 年 6 月 30 日
亞洲短期債券基金	105.68	74.90%	2024 年 6 月 30 日
亞洲小型公司基金	176.87	82.04%	2024 年 6 月 30 日
中華威力基金	179.46	94.88%	2024 年 6 月 30 日
巨龍增長基金	201.03	97.22%	2024 年 6 月 30 日
領先動力基金	25.40	87.97%	2024 年 6 月 30 日
新興東歐基金	237.82	75.07%	2024 年 6 月 30 日
歐洲增長基金	30.48	97.93%	2024 年 6 月 30 日
環球氣候行動基金	8.02	99.68%	2024 年 6 月 30 日
環球股票基金	65.28	97.82%	2024 年 6 月 30 日
環球多元資產入息基金	108.67	79.73%	2024 年 6 月 30 日
環球房地產投資信託產業基金	8.15	96.12%	2024 年 6 月 30 日
環球資源基金	185.15	94.96%	2024 年 6 月 30 日
康健護理基金	3.36	97.27%	2024 年 6 月 30 日
印度股票基金	375.92	89.42%	2024 年 6 月 30 日
投資級優先證券收益基金	186.82	87.12%	2024 年 6 月 30 日
日本股票基金	35.02	97.57%	2024 年 6 月 30 日
優先證券收益基金	220.94	85.83%	2024 年 6 月 30 日
可持續亞洲債券基金	30.91	64.13%	2024 年 6 月 30 日
可持續亞洲股票基金	36.49	94.99%	2024 年 6 月 30 日
台灣股票基金	48.31	97.39%	2024 年 6 月 30 日
美國股票基金	21.73	97.35%	2024 年 6 月 30 日
美國小型公司基金	46.86	93.20%	2024 年 6 月 30 日
美國特別機會基金	122.72	77.35%	2024 年 6 月 30 日
美元入息基金	130.58	66.49%	2024 年 6 月 30 日

宏利香港系列

宏利資本穩健基金	70.66	58.35%	2024 年 6 月 30 日
宏利環球動態資產配置基金	63.34	63.89%	2024 年 6 月 30 日
宏利環球多元資產入息基金	108.68	79.37%	2024 年 6 月 30 日
宏利 STARS 收益及增長基金	111.38	56.41%	2024 年 6 月 30 日

*氣候相關風險被認為與某些類型的投資無關。詳情請參考[氣候相關風險管理的披露](#) (manulifefunds.com.hk)。與氣候相關風險無關的基金於以上列表的碳足跡及數據範圍均被標示為「不適用」。

†自 2023 年 10 月 3 日起，宏利 MPF 恒指基金（「該基金」）的相關緊貼指數集體投資計劃（「緊貼指數集體投資計劃」）已變更為華夏恒指 ESG ETF（「新緊貼指數集體投資計劃」）。相應地，(i)該基金的名稱已變更為宏利 MPF 恒指 ESG 基金，且(ii)該基金的投資目標及投資均衡性，以及氣候相關風險的相關性已作出變更，以體現新緊貼指數集體投資計劃的投資政策。詳情請參閱[相關通告](#)(manulife.com.hk)。

標有（*）記號的基金不適用於香港零售投資者。

標有（^）記號的基金並未於香港授權。

在適當情況下，宏利投資管理依賴第三方數據供應商及第三方管理人，而後者又依賴公司披露的數據、估計及其他來源來產生數據。宏利投資管理概不保證該等第三方數據的準確性或完整性。

公司申報的碳排放量可能存在估計誤差。企業申報的氣候相關數據通常未經審核或以低於財務審核的標準審核。

數據範圍的計算方法是將基金投資組合中具有合理可用數據以供宏利投資管理計算碳足跡的投資的價值除以基金投資組合的總價值。

*即使採取了合理步驟以鑒定基金相關投資的範圍一和範圍二排放量的投資組合碳足跡，數據範圍可能不足以得出對基金實際投資組合而言有意義或代表性的投資組合碳足跡。因此，數據範圍低於 50% 的基金於以上列表的碳足跡被標示為「不適用」。

作為參考之用，數據範圍可能受到現金、現金等價物和衍生工具、主權及半主權債券、證券化資產、市政債券和相關證券，及任何未具有合理可用數據以供宏利投資管理計算碳足跡的證券的影響。

為釋疑起見，若基金採用主基金—聯接基金結構，聯接基金將受到主基金附帶的風險所影響，包括氣候相關風險，此等風險由該主基金的投資管理人管理。就屬於主基金—聯接基金結構的一部分的基金而言，聯接基金的數據可能無法提供，直至主基金已在主基金的首個報告期提供數據。若主基金的投資經理人可能不受類似的披露要求約束，則數據的供應可能會受到限制。

隨著行業標準演變、數據可用性改善，以及宏利投資管理提高其氣候報告能力，數據披露、數據來源及方法可能在未來改變。本披露文件可能在未有任何事先通知下不時更新。

重要資料

宏利投資管理是宏利金融的環球財富及資產管理分部。本文件只供相關司法權區適用法例及規例容許收取本文件的收件人使用，內容由宏利投資管理編製，當中的觀點為撰寫文件當日的意見，並可予以更改。宏利投資管理乃根據其認為可靠的來源編匯或得出本文件的資料及／或分析，惟對其準確性、正確性、有用性及完整性概不發表任何聲明，對因使用有關資料及／或分析而引致的任何損失亦概不負責。宏利投資管理、其聯屬公司或彼等之任何董事、高級職員或僱員，對任何人士倚賴或不倚賴本文件所載資料行事而引致的任何直接或間接損失、損害或任何其他後果，概不承擔法律責任或其他責任。

本文件的資料僅供參考，並不構成代表宏利投資管理向任何人士提出買賣任何證券的建議、專業意見、要約或邀請。本文件的資料不得視為現時或過去的建議，或游說買賣任何投資產品或採納任何投資策略的要約。本文件所載的所有資料概不構成投資、法律、會計或稅務意見，或任何投資或策略適用於閣下個別情況的聲明，或構成向閣下提出的個人建議。過往回報並不預示未來業績。

投資涉及風險。投資者不應只單靠本資料而作出投資決定，而應仔細閱讀銷售文件(如適用)，以獲取詳細資料，包括任何投資產品的風險因素、收費及產品特點。

專有信息 — 未經宏利投資管理事先同意，不得以任何形式或就任何目的向任何第三方複製、分發、傳閱、散播、刊登或披露本文件全部或任何部分內容。

本文件由宏利投資管理(香港)有限公司刊發。

證券及期貨事務監察委員會並未有審閱此文件。