

基金投資限制新增說明

根據境外基金管理辦法第12條第1項第6款之規定辦理。

本公司擔任總代理之摩根投資基金(JPMorgan Investment Funds) 2022年10月份公開說明書進行更新，其中包含調整摩根投資基金－多重收益基金之投資限制以及ESG類別，分別說明如下：

- 1.基金之投資限制新增可投資其資產之20%於股權連結債券。
- 2.基金之ESG類別調整為「ESG推廣」，表示符合歐盟永續金融揭露規則之第8條，基金之投資政策亦配合新增說明，主要為：
 - 至少51%之資產將投資於具有積極環境及/或社會特性的公司，且該等公司遵循良好的公司治理慣例，此係透過投資經理人專有的ESG 評分方法及/或第三方資料衡量之。
 - 基金至少10%之資產(不包括附屬流動資產、信用機構存款、貨幣市場工具、貨幣市場基金及為有效投資組合管理而使用之衍生性商品)將投資於SFDR 所定義之促進環境或社會目標的永續投資項目。
 - 投資經理人將評估並採用基於價值觀及規範之篩選，以進行排除。

上述新增之內容反映該基金目前之管理方式，且不影響該基金之風險概況。

本公司茲依規定更新基金公開說明書中譯本及相關基金之投資人須知。特此公告。

基金投資限制新增說明

根據境外基金管理辦法第12條第1項第6款之規定辦理。

本公司擔任總代理之摩根投資基金(JPMorgan Investment Funds) 2022年10月份公開說明書進行更新，其中包括以「附屬流動資產」一詞取代現行於公開說明書上所載之「現金及約當現金」，並於各子基金之投資策略新增或調整附屬流動資產、信用機構存款、貨幣市場工具及貨幣市場基金之相關投資部位限制或說明。各子基金可持有至多20%之淨資產於附屬流動資產以管理現金申購及贖回，與現行及特殊之款項。於極端不利之市場情況下，因暫時防禦性目的，可持有至多100%之淨資產於附屬流動資產以減緩極端市場情況下之風險，維護投資人之最佳利益。

本公司茲依規定更新基金公開說明書中譯本及投資人須知。特此公告。

新增風險說明揭露

根據境外基金管理辦法第12條第1項第6款之規定辦理。

本公司擔任總代理之摩根投資基金(JPMorgan Investment Funds) 2022年10月份公開說明書進行更新，其中包括新增股權連結債券之風險說明，內容如下：

「股權連結債券不僅受到標的資產價值波動的影響，亦曝露在其發行人違約或破產之風險中，可能造成其債券全部市值之損失(交易對手風險)。」

本公司茲依規定更新基金公開說明書中譯本。特此公告。

風險值法模型參數調整

根據境外基金管理辦法第12條第1項第6款之規定辦理。

本公司擔任總代理之摩根投資基金(JPMorgan Investment Funds) 2022年10月份公開說明書進行調整，其中包括調整全系列基金之風險值法模型參數，原先估計值係基於子基金過去12個月(至少250個營業日)期間之績效表現，現變更為過去36個月之績效表現。此變更將不影響基金之管理方式亦不影響基金之風險概況。

本公司茲依規定更新基金公開說明書中譯本及投資人須知第二部分，特此公告。