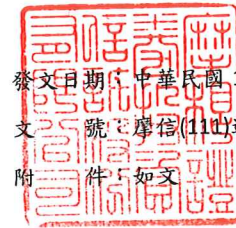


## 函



發文日期：中華民國 111 年 11 月 9 日

文號：摩信(111)通字第 480 號

附件：如文

受文者：各銷售機構(如附件一)

主旨：為通知本公司總代理之摩根投資基金(JPMorgan Investment Funds)公開說明書中譯本(下稱「公開說明書」)及相關投資人須知之變動事項相關事宜如說明，敬請 查照。

說明：

- 一、 本公司獲境外基金管理機構通知，2022 年 10 月份公開說明書更新業經盧森堡主管機關核准，並依據境外基金管理辦法第 11 條規定辦理。
- 二、 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，其中包含：

- (一) 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。
  3. 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。
- (二) 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。
- (三) 新增股權連結債券之風險說明：「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價之損失(交易對手風險)。」



# 摩根

資產管理

# J.P.Morgan

ASSET MANAGEMENT

(四) 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。

三、 敬請 貴公司再行將前述事宜轉知所屬分支機構或投資人。若有任何疑問，請電詢：  
(02)8726-8686。

摩根證券投資信託股份有限公司

董事長 唐德瑜

