

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)。」

(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



附件一

花旗(台灣)商業銀行股份有限公司
中國信託商業銀行股份有限公司
國泰世華商業銀行股份有限公司
華南商業銀行股份有限公司
臺灣中小企業銀行股份有限公司
合作金庫商業銀行股份有限公司
日盛國際商業銀行股份有限公司
台北富邦商業銀行股份有限公司
玉山商業銀行股份有限公司
第一商業銀行股份有限公司
兆豐國際商業銀行股份有限公司
彰化商業銀行股份有限公司
台新國際商業銀行股份有限公司
上海商業儲蓄銀行股份有限公司
永豐商業銀行股份有限公司(理財商品部)
臺灣土地銀行股份有限公司
陽信商業銀行股份有限公司
京城商業銀行股份有限公司
高雄銀行股份有限公司
聯邦商業銀行股份有限公司
安泰商業銀行股份有限公司
板信商業銀行股份有限公司
元大商業銀行股份有限公司
臺灣新光商業銀行股份有限公司
台中商業銀行股份有限公司
遠東國際商業銀行股份有限公司
華泰商業銀行股份有限公司
三信商業銀行股份有限公司
臺灣銀行股份有限公司
凱基商業銀行股份有限公司
星展(台灣)商業銀行股份有限公司
渣打國際商業銀行股份有限公司
匯豐(台灣)商業銀行股份有限公司
瑞興商業銀行股份有限公司
瑞士商瑞士銀行股份有限公司台北分公司
法商法國巴黎銀行股份有限公司台北分行
凱基證券股份有限公司

富邦綜合證券股份有限公司
元富證券股份有限公司
第一金證券股份有限公司
群益金鼎證券股份有限公司
統一證券股份有限公司
元大證券股份有限公司
日盛證券股份有限公司
永豐金證券股份有限公司
兆豐證券股份有限公司
華南永昌綜合證券股份有限公司
國泰綜合證券股份有限公司
新加坡商瑞銀證券股份有限公司台北分公司
基富通證券股份有限公司
中租證券投資顧問股份有限公司
鉅亨證券投資顧問股份有限公司
香港上海滙豐證券股份有限公司
中國人壽保險股份有限公司
台灣人壽保險股份有限公司
全球人壽保險股份有限公司
宏泰人壽保險股份有限公司
保誠人壽保險股份有限公司
國泰人壽保險股份有限公司
第一金人壽保險股份有限公司
安聯人壽保險股份有限公司
富邦人壽保險股份有限公司
新光人壽保險股份有限公司
法商法國巴黎人壽保險股份有限公司台灣分公司
臺銀人壽保險股份有限公司
合作金庫人壽保險股份有限公司
英屬百慕達商安達人壽保險股份有限公司台灣分公司
國際康健人壽保險股份有限公司
三商美邦人壽保險股份有限公司
南山人壽保險股份有限公司