

## 貝萊德證券投資信託股份有限公司 函

地址：臺北市松仁路 100 號 28 樓  
聯絡人：江亦雅  
聯絡電話：(02)2326-1619  
傳 真：(02)2326-3698

受文者：各銷售機構

發文字號：(112)貝萊德字第 104 號

發文日期：中華民國 112 年 9 月 14 日

附件：致股東信函、受影響基金清單

主旨：謹通知貝萊德證券投資信託股份有限公司（下稱「本公司」）所代理之貝萊德全球基金系列暨部分子基金之重要變更及生效日期，詳如說明，敬請 查照。

說明：

一、就本次貝萊德全球基金系列暨部分子基金之變更，請以本函說明及所附之致股東信函為準；以下謹就變更事項說明如下，除本函另有說明外，本函所載之變更預計自民國（下同）**112 年 10 月 26 日**（以下稱「生效日」）起生效。

### 二、基金中文名稱之變更—此變動係屬變更基金名稱之重大變更

「貝萊德智慧數據環球小型企業基金」（下稱「本基金」）之中文名稱自 **112 年 9 月 8 日** 變更為「貝萊德智慧數據**永續**環球小型企業基金」。

本基金之名稱變更暨 ESG 認可乙案業經金融監督管理委員會以 112 年 9 月 8 日金管證投字第 1120347896 號函核准變更在案，詳請參閱本基金載明永續相關揭露之公開說明書及投資人須知。基金中英文名稱變更前後對照表如下：

現行名稱（中英文）	更名後名稱（中英文）
貝萊德智慧數據環球小型企業基金 BlackRock Global Funds – Systematic Global SmallCap Fund	貝萊德智慧數據 <b>永續</b> 環球小型企業基金 BlackRock Global Funds – Systematic <b>Sustainable</b> Global SmallCap Fund

本基金此次除名稱變更外，其投資目標政策、投資標的、基金風險報酬等級及基金風險狀況等皆無變動，併此說明。

### 三、ESG 公開說明書之變更

1. 對基金投資目標及政策之說明及「契約前揭露」所作之變更（詳公開說明書之附錄辛）

自生效日起，下表所列基金之投資策略將修改某些環境、社會及治理（下稱「ESG」）特徵，為反映持續發展之最佳實踐，以提升該等基金之一致性或強化其 ESG 承諾。

該等變更係為了使基金更能符合我們的股東及未來客戶對於資產管理領域持續發展的

期待，尤其是與 ESG 投資有關之部分，其整體目標係為尋求提供全面性與永續性的投資取向。

基金名稱	自生效日起之承諾
貝萊德新世代運輸基金 (基金之配息來源可能為 本金)	契約前揭露業經修訂，以與基金投資政策所揭露之內容 保持一致。

對於被歸類為永續投資的 SFDR 第 8 條及 SFDR 第 9 條基金而言，其與環境及／或社會目標之永續投資股份相關之揭露資訊已更新於契約前揭露中。

## 2. 所有基金對「主要不利影響」之考量

公開說明書已明確指出「投資顧問在做出投資決策時可以取用一系列數據來源，其中包含主要不利影響的數據」。儘管貝萊德會就所有投資組合考量 ESG 風險，並且這些風險可能與主要不利影響相關的環境或社會主題同時發生，惟除非 SFDR 契約前揭露中另有說明，否則該等基金並未承諾在做出投資選擇時考量主要不利影響。

## 3. SFDR 「契約前揭露」之更新

隨著《授權細則 Delegated Regulation》發佈後，修訂了有關特定能源領域經濟活動之《授權細則 (EU) 2021/2139》及規範該等經濟活動應具體公開揭露之《授權細則 (EU) 2021/2178》，公開說明書附錄辛之契約前揭露已更新，其中包含圖表以展示該基金投資於符合歐盟永續金融分類標準之天然氣及核能相關活動之程度。

## 4. ESG 變更的影響

上表所列基金之變更將訂明強化之 ESG 投資策略，且不會對各基金之風險及報酬產生重大變化，進而符合股東之最佳利益且對新投資者具有吸引力。

## 四、其他公開說明書之變更

### 1. 貝萊德 ESG 社會責任多元資產基金（基金之配息來源可能為本金）之變更—使用指標之新增說明

生效日起，使用指標部分將包含以下揭露：

「有關指數之組成部分（即 50% 摩根士丹利世界指數 (MSCI World Index) 及 50% 彭博全球綜合債券歐元避險指數 (Bloomberg Global Aggregate Bond Index hedged to EUR)) 可能會在與基金相關之銷售文件中單獨被引用」。

### 2. 證券借貸

下表所示基金之證券借貸預期占資產淨值的比例將有所變動。為免疑義，該等基金對證券借貸之最高承擔比例將維持不變。



基金	現行證券借貸占資產淨值之預期百分比 (%)	計劃中證券借貸占資產淨值之預期百分比 (%)
貝萊德歐洲靈活股票基金	11	14
貝萊德 ESG 社會責任多元資產基金 (基金之配息來源可能為本金)	40	19
貝萊德營養科學基金	24	19
貝萊德永續能源基金	22	19

### 3. 所有基金

#### (1) 股息政策

分配收入尚未扣除開支的配息股份亦稱為總收益配息股份 (G)，例如 A4(G) 類股份。為免疑義，未列入「股息政策」一節的基金亦可發行總收益配息股份 (即該等基金不擬針對其所有配息股份類別中分配尚未扣除開支之收入)。

#### (2) 增添模型風險之免責聲明

下述特定風險之「模型風險」適用於特定基金投資，並已新增於「特殊風險考慮因素」一節：

「該基金尋求透過使用包含量化分析的專有模型來實現其投資目標。由於模型中納入之各種因素及其權重、歷史趨勢變化以及模型建構與實施之問題 (包含但不限於軟體問題及其他技術問題)，使用這些模型選擇的投資決策表現可能與預期的表現不同。無法保證貝萊德使用這些模型即能對基金做成有效的投資決策。模型所使用的資料與數據可能由第三方提供，而不準確或不完整的數據可能會限制模型的成效。此外，貝萊德所使用的部分數據可能係歷史數據，未必能準確預測未來之市場趨勢。存有這些模型可能無法成功地選擇投資項目或決定投資部位權重，而使基金無法順利達成其投資目標的風險。」

建議查看「特殊風險考慮因素」一節的表格，以確認該風險是否適用於其投資之基金。

#### (3) 資本增長風險

在某些基金及／或股份類別自資本或收入及已實現和未實現淨資本收益中做出之分配，已明確指出：

「在市場波動或異常狀況時，基金的收入水準可能會降低。這可能會導致分配的穩定性受到損害，同時增加來自資本、已實現及未實現淨收益所作之分配，以減少每股配息率的波動，進而可能增加資本侵蝕的風險並降低資本成長之潛力。」

以上適用於多幣別穩定月配息股份、穩定配息股份及總報酬穩定配息股份。

- 五、上述變動將不會導致該等基金及／或其股東承擔的費用及支出產生任何變化。相關費用及支出（例如郵資費）將由管理公司自向該等基金收取的年度服務費中支付。該等變更將不會對基金股東之權利或利益造成重大損害。詳細內容請參照致股東信函之說明及於生效日更新之基金公開說明書。投資人如不同意上述變更，可依公開說明書內容規定，於生效日前免費贖回股份。祈請 貴銷售機構將上揭事項即時通知所屬投資人，特此通知。

正本：上海商業儲蓄銀行股份有限公司、中國信託商業銀行股份有限公司、兆豐國際商業銀行股份有限公司、永豐銀行理財商品部、台北富邦商業銀行股份有限公司、台新國際商業銀行股份有限公司、台灣銀行股份有限公司、合作金庫商業銀行股份有限公司、國泰世華商業銀行股份有限公司、彰化商業銀行股份有限公司、渣打國際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、台灣中小企業銀行股份有限公司、台灣新光商業銀行股份有限公司、華南商業銀行股份有限公司、滙豐(台灣)商業銀行股份有限公司、台灣土地銀行股份有限公司、遠東國際商業銀行股份有限公司、元大證券股份有限公司、基富通證券股份有限公司、群益金鼎證券股份有限公司、華南永昌綜合證券股份有限公司、德商德意志銀行台北分行、法商法國巴黎銀行台北分行、瑞士銀行台北分行、元大商業銀行股份有限公司、星展(台灣)商業銀行股份有限公司、永豐金證券股份有限公司、新加坡商瑞銀證券股份有限公司台北分公司、鉅亨網證券投資顧問股份有限公司、元富證券股份有限公司、香港上海匯豐證券股份有限公司、中租證券投資顧問股份有限公司

## 貝萊德證券投資信託股份有限公司

總經理 余曉光



## 附件 臺灣受影響之基金清單

基金中文全名	ISIN
貝萊德智慧數據永續環球小型企業基金 Hedged A2 澳幣 (原名「貝萊德智慧數據環球小型企業基金 Hedged A2 澳幣」)	LU1023057448
貝萊德智慧數據永續環球小型企業基金 A2 歐元 (原名「貝萊德智慧數據環球小型企業基金 A2 歐元」)	LU0171288334
貝萊德智慧數據永續環球小型企業基金 A2 美元 (原名「貝萊德智慧數據環球小型企業基金 A2 美元」)	LU0054578231
貝萊德新世代運輸基金 A2 美元	LU1861214812
貝萊德新世代運輸基金 A2 歐元	LU2400292194
貝萊德新世代運輸基金 Hedged A2 歐元	LU1861215389
貝萊德新世代運輸基金 A10 美元(總報酬穩定配息)	LU2533727025
貝萊德 ESG 社會責任多元資產基金 Hedged A2 澳幣	LU2250418493
貝萊德 ESG 社會責任多元資產基金 Hedged A2 南非幣	LU2250418576
貝萊德 ESG 社會責任多元資產基金 A8 多幣別穩定月配息股份-美元幣避險	LU2092627202
貝萊德 ESG 社會責任多元資產基金 Hedged A2 美元	LU0494093205
貝萊德 ESG 社會責任多元資產基金 A2 歐元	LU0093503497
貝萊德 ESG 社會責任多元資產基金 Hedged A10 美元(總報酬穩定配息)	LU2452424414
貝萊德歐洲靈活股票基金 A2 歐元	LU0224105477
貝萊德歐洲靈活股票基金 A2 美元	LU0769137737
貝萊德營養科學基金 Hedged A2 歐元	LU0471298348
貝萊德營養科學基金 A2 美元	LU0385154629
貝萊德永續能源基金 A2 歐元	LU0171289902
貝萊德永續能源基金 A2 美元	LU0124384867
貝萊德永續能源基金 A10 美元(總報酬穩定配息)	LU2533724782