

宏利證券投資信託股份有限公司 公告

中華民國 111 年 6 月 10 日

宏投字第 111139 號

主旨：愛德蒙得洛希爾大數據基金公說書修訂

說明：

一、依「境外基金管理辦法」第 12 條第 1 項第 6 款規定辦理。

二、有關愛德蒙得洛希爾大數據基金（下稱「**本子基金**」）公說書之變更將於 2022 年 7 月 18 日（下稱「**生效日**」）生效。

三、旨揭修訂之內容摘要如下：

1. 針對公開說明書中與本子基金相關之特定部分中「目標與投資政策」作出如下之修正（新增之部分以底線表示，刪除之部分以括號表示〔•〕）（下稱「**本修正**」）

#### 目標

本子基金的投資目標是透過投資國際資本市場並藉由篩選科技產業或與大數據分析之先進技術相關的公司，以在 5 年投資期間內超越其基準指標。本子基金採主動式管理。

環境、社會及公司治理（ESG）標準為管理要素之一環，惟其於最終決定中之權重並未事先界定。

#### 投資政策與投資限制

投資經理公司將系統性地將環境、社會及公司治理（ESG）因素納入其財務分析，以篩選投資組合之有價證券。

投資組合中至少 90% 之公司將具備 ESG 評等。其將為自有之 ESG 評等或由外部之非金融評等機構提供。於此程序結束時，本子基金將具備較其投資範圍更高之 ESG 評等。

此外，有價證券篩選程序亦包含負面篩選，以排除依據國際公約，於該地區致力於爭議性武器製造之公司，以及依據愛德蒙得洛希爾集團（Edmond de Rothschild Group）之排除政策下，從事與燃料煤或菸草相關活動之公司，該等排除政策可於愛德蒙得洛希爾之網頁閱覽。

本子基金因提倡 ESG 特徵之結合而被歸類於 SFDR 第 8(1) 條，惟其並未為實現環境或社會特徵之目的而指定一參考指標。

鑑於其 ESG 策略，本子基金提倡環境特徵，但並不投資於環境永續之經濟活動。此金融產品之投資並未考量歐盟就環境永續經濟活動之標準。基此，就分類規則而言，「不造成重大損害」之原則並不適用於本子基金下之投資。

本子基金將其淨資產的至少 51% 投資於科技相關產業或與大數據分析之先進技術相關的公司所發行之證券。

本子基金淨資產之 75%-110% 將 [ 投資於及/或 ] 曝險 (直接或間接) 於國際股票市場及其他類似證券。本子基金也可持有 ADR (美國存託憑證)、GDR (全球存託憑證) 及無表決權之證券。

本子基金可透過滬港通計劃將最高達 30% 之淨資產投資於中國 A 股。

為了管理現金，本子基金最多可投資淨資產之 25% 於可轉讓債務證券、貨幣市場工具與貨幣市場基金。本子基金將尋求於購買時為投資等級的公開或私人發行者之發行人 (即該評等高於或相當於標準普爾 BBB- 等級，或其它獨立機構給予的相當評等，或由投資經理公司對未經評等證券視為相當的評等) 且僅具不到三個月的短期到期日。

本子基金得依據第 5 章「投資限制」所列之限制使用衍生性金融工具以達成其投資目標。此類工具亦得為避險目的使用。該等工具包括但不限於：

- 股票選擇權與股票指數合約，以降低股票的波動性並增加本子基金對特定數量股權之曝險；
- 股票指數期貨合約，以管理對股權之曝險；或
- 貨幣遠期合約 (遠期外匯合約或外匯期貨) 或貨幣交換合約 [，以就特定貨幣風險進行避險]。

本子基金不使用總報酬交換或證券借貸交易。

本子基金亦可在輔助基礎上持有嵌入式衍生性工具 (認股權證或權證)，最高可達其淨資產的 10%。使用嵌入式衍生工具將不會使子基金的整體曝險增加超過子基金淨資產的 110%。

本子基金可將最高其淨資產之 10%，投資可轉讓證券集合投資事業或其他投資基金之單位或股份。」

2. 修正公開說明書之一般部份 (下稱「**一般修正**」)，尤其是為了 (除其他部分外) 釐清第 5 段 (投資限制) 之內容，以反映 2010 年 12 月 17 日法律規定之法規限制，其詳載於修訂版之公開說明書。
3. 若臺端不同意上述第 1 項之變更，臺端可於 2022 年 7 月 15 日之前，免費申請買回或將臺端持有之相關基金轉換為任何其他基金中相同類別或類型之股份。
4. 欲獲取關於本通知中任何事項詳細資訊之股東，可於正常營業時間撥打電話愛德蒙得洛希爾系列基金之台灣區總代理-宏利證券投資信託股份有限公司服務電話：0800-070-998。