

宏利證券投資信託股份有限公司 公告

中華民國 111 年 6 月 13 日

宏投字第 111146 號

主旨：愛德蒙得洛希爾歐元可轉債基金公說書修訂

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歐元可轉債基金（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**」）

#### **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% 之債務證券及貨幣市場工具將具備 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。

本子基金將投資至少淨資產之 60% 於可轉換或可交換債券及參與權證券或其他相似之可轉換為註冊於歐洲國家公司或於該等地區進行主要經濟活動公司之股票的固定收益證券。

投資流程結合債券策略和股票篩選（選股）。將優先考量可產生自由現金流量和提高收益成長的公司。〔這個策略的一部分是投資經理公司就可轉換債券之選擇，係至少本子基金淨資產之 50% 將由投資等級或相等之發行所組成。〕在管理投資組合時，將剔除已顯現類似股權運作情況的可轉換或可交換債券，並以較不敏感的債券替代。得投資最高本子基金淨資產之 20% 於應急可轉換債券。

〔本子基金得投資最高淨資產之 10% 於合成可轉換債券、權證或其他任何具股權特性的債券。〕

本子基金得投資最高達 10% 之淨資產於股權、強制及優先可轉換債券，而不受資本規模或地域之限。

本子基金將投資最高達 110% 之淨資產於「投資等級」及「非投資等級」之發行（即分別是該評等高於或相當及低於標準普爾 BBB-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債務證券視為相當的內部評等。）

據了解，任何債務證券都可能面臨被下調至較低信用評級的風險。在證券或發行人的信用評級被下調的情況下，本子基金可根據投資經理公司之全權決定，及為本子基金股東的最佳利益，繼續持有該等被下調評級的債務證券，惟在任何情況下，本子基金對艱困證券的最高投資額將限制在其淨資產的 5% 以內。

投資組合持有的證券可使用歐元以外的貨幣計價，最高佔淨資產之 50%。但貨幣風險不得超過淨資產之 20%。

〔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。〕

本子基金最多可投資淨資產之 25% 於不可轉換之可轉讓債務證券。

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：

- 貨幣實物交割及無本金交割遠期合約、交換合約、貨幣期貨或選擇權；
- 期貨、選擇權或期貨選擇權，以就股票市場風險或利率風險進行避險，或提高利率風險或股票市場風險之曝險；
- 單一股票選擇權；
- 波動性衍生性商品：波動率指數之期貨、選擇權、期貨選擇權；
- 指數及單一名稱信用違約交換合約；
- 總報酬交換。

本子基金所將按第 5 章投資限制第 D(9)節表格所列之該資產百分比進行總報酬交換。

本子基金將不使用證券借貸交易。

為達到其投資目標及獲得國際股票或利率市場之部位，本子基金得投資最高達 110% 之淨資產於包含嵌入式衍生性金融商品的可轉讓證券。特別是，本子基金可投資於可轉換債券、EMTN（歐洲中期債券）、指數掛鉤債券、認股權證及憑證。

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它投資基金之單位或股份。

本子基金對股票市場的淨曝險可能在 20% 至 80% 之間變動。此種曝險得以直接持有股票、透過投資可轉換債券、可交換債券及/或透過投資於衍生工具或 UCI 之的股份/單位方式實現。

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，臺端可於本通知之日起至 2022 年 7 月 15 日止之一個月內（「買回通知期間」）免費買回您的股份。買回通知期間內之買回將遵守公開說明書之規定，但無需支付買回費用或收費。
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。