

檔 號：

保存年限：

摩根證券投資信託股份有限公司 函

受文者：凱基商業銀行股份有限公司

發文日期：中華民國112年10月31日

發文字號：摩信(112)通字第1120000428號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：

附件：如文

主旨：為通知本公司總代理之「摩根澳洲基金（JPMorgan Australia Fund）」（下稱「本基金」）擬變更基金中英文名稱為「摩根亞洲股票高息基金（JPMorgan Asia Equity High Income Fund）」，同步變更投資目標及政策、基金管理費用（上調）及其他行政成本費用負擔等相關事宜（下稱「本次變更」）及調整本基金風險報酬等級，敬請惠予配合辦理。

說明：

- 一、本公司接獲境外基金管理機構通知（附件一），本基金擬自民國（下同）112年12月21日（下稱「生效日」）起變更基金中英文名稱、投資目標及政策及基金管理費用調整等事宜，於112年7月18日經金融監督管理委員會金管證投字第1120346935號函（如附件二）核准在案。
- 二、本次變更前後對照表及因本次變更衍生之相關風險、基金管理費用上調（原為0.75%，調整後為1.5%）及由本基金承擔之其他行政成本費用為44,000美元等詳細說明請參閱附件三，另本基金之新舊中文名稱自生效日起將於投資人須知及公開說明書中譯本併陳一年。
- 三、爰本基金於101年8月13日起已不再接受新申購，故自生效日起本基金仍維持不接受投資人對本基金之新申購（含

單筆新申購、轉申購、新申請之定時（不）定額）。原持有本基金之投資人得繼續持有或得辦理買回、轉出交易。惟為維護投資人之權益，既有之定期（不）定額之投資人每月扣款之申購不受影響，惟不可增加扣款金額、日期及頻率。

- 四、本基金本次變更後之風險報酬等級將由RR 4調升為RR 5，請貴公司特別留意並依據所屬投資人之風險屬性進行基金適合度評估或相關控管機制規定辦理。
- 五、本次變更自全球統一公告日（即112年11月14日）起至112年12月20日交易截止時間止，本基金持有人辦理本基金之買回或轉換其持有單位數至本公司總代理之其他境外基金，本公司均不予收取其買回或轉換費用；前述費用不包含銷售機構對投資人收取的服務費用。
- 六、本次變更本公司將於全球統一公告日發佈投資人信函、公告相關事宜，並同步公告於境外基金資訊觀測站，並於生效日更新境外基金公開說明書及投資人須知。敬請貴公司自全球統一公告日後再將前述相關事宜轉知貴公司所屬投資人。
- 七、如有其他相關問題，請洽本公司（02）8726-8686。

正本：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、台北富邦商業銀行股份有限公司信託業務處、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、永豐銀行理財信託處、臺灣土地銀行、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、板信商業銀行作業服務部、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、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、香港商香港上海匯豐銀行股份有限公司台北分公司、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、法商法國巴黎銀行台北分公司、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、群益金鼎證券股份有限公司、統一綜合證券股份有限公司、元大證券股份有限公司、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、台新綜合證券股份有限公司、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、香港上海匯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、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、第一金人壽保險股份有限公司、合作金庫人壽保險股份有限公司、安達國際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、好好證券股份有限公司、台新人壽保險股份有限公司、王道商業銀行股份有限公司

副本：

來文

【附件三】本次變更前後對照表與相關風險

	變更生效日前	變更生效日起
基金名稱	<p>摩根澳洲基金</p> <p>JPMorgan Australia Fund</p>	<p>摩根亞洲股票高息基金</p> <p>JPMorgan Asia Equity High Income Fund</p>
現有基金級別	<p>摩根澳洲(美元)(累計)</p> <p>JPMorgan Australia (acc) - USD</p>	<p>摩根亞洲股票高息(美元)(累計)</p> <p>JPMorgan Asia Equity High Income (acc) - USD</p>
ISIN code	HK0000055613	
風險報酬等級	RR4	RR5
投資目標	<p>基金之投資政策為透過主要（即將其總資產淨值至少 70%）投資於在澳洲證券交易所上市的公司的股票證券，為投資者提供長遠資本增值。</p>	<p>投資政策為透過主要（即將其總資產淨值至少 70%）投資於亞洲（日本除外）上市公司的股票證券，並在適當情況下使用衍生工具，從而產生高水平的收入，同時維持長遠資本增值前景。同時，基金擬透過使用衍生工具提供波動幅度小於大盤的回報來源。</p>
投資政策摘要	<p>基金管理機構旨在於行業及證券層面分散風險，同時利用以下有望提高長期風險調整後報酬因素。基金管理機構將採用專有量化流程，該流程根據多重因素挑選所投資的證券：</p> <ul style="list-style-type: none"> • 價值 - 根據到期收益率、獲利收益率、股息收益率及現金流量收益率等基本因素，挑選其價格較行業內其他股票證券更加吸引的股票證券。 • 動能(價格正在上升的股票將繼續上升，而價格正在下跌的股票將繼續下跌的趨勢) - 挑選動能較高且在 12 個月期間內的風險調整後報酬較行業內其他股票證券為高的股票證券。就此而言，風險調整後報酬按 12 個月內的回報除以 12 個月內的波幅計算。 	<p>為達投資目標，基金尋求透過一個專有基本因素研究流程以根據其財務預測、評價及收入與資本增值潛力識別具吸引力的風險／回報特徵及股息收益率的股票，建構一個多元化的亞洲股票投資組合，而該等投資組合合計產生的收益將高於大盤指標。此外，基金將透過出售亞洲（日本除外）地區的指數買權及指數期貨買權產生額外收入，並尋求從相關權利金中提供每月收入來源。</p> <p>基金在亞洲任何國家（日本除外）（包括新興市場國家）或行業可投資的總資產淨值的比例不受任何限制，其可投資的公司市值亦不受任何限制。</p>

【附件三】本次變更前後對照表與相關風險

	<p>• 品質 - 挑選其品質較行業內其他股票證券更高的股票證券(按獲利能力、獲利品質及償債能力/財務風險衡量)。</p> <p>基金在任何行業可投資的總資產淨值的比例不受任何限制，其可投資的公司市值亦不受任何限制。</p> <p>基金亦可為投資目的而投資於衍生工具，例如遠期合約、選擇權、認股權證及期貨。</p> <p>作為基金之投資流程的一部分，投資經理人納入在財務上屬於重大的環境、社會及治理因素。請參閱「投資目標、政策及限制」一節內「納入 ESG」分節，了解詳情。</p>	<p>基金可將其總資產淨值少於 30%投資於在亞洲(日本除外)註冊或投資的上市不動產投資信託基金(「REIT」)。</p> <p>基金於中國 A 股及 B 股(包括透過「滬港通」及/或「深港通」投資的合資格中國 A 股)的總投資(直接及間接)不可超過其總資產淨值的 20%。</p> <p>作為基金之投資流程的一部分，投資經理人納入在財務上屬於重大的環境、社會及治理因素。請參閱「投資目標、政策及限制」一節內「納入 ESG」分節，了解詳情。</p> <p>基金亦可為避險及投資目的而投資於證監會不時允許的衍生工具，例如選擇權、認股權證及期貨。</p>
管理費率	0.75%	1.50%

鑑於上述變更，基金可能承受額外/更高的投資風險，包括以下風險：

1. 衍生工具風險—與衍生工具相關的風險包括交易對象/信貸風險、流動性風險、評價風險、波動風險及櫃買交易風險。衍生工具的槓桿元素/成分可能導致虧損大幅高於基金投資於衍生工具的金額。投資於衍生工具可能導致基金蒙受大幅虧損的高風險。
當出售指數買權及指數期貨買權時，基金會獲得現金權利金，但基金從標的工具市值上升中受惠的機會局限於當該工具達到選擇權執行價格時的市值(另加所獲得的權利金)。在大盤上升時，基金將被要求提供額外現金抵押品並可能需要出售所持有的證券以籌措現金，與直接持有證券相比，這可能限制其上升潛力。
2. 新興市場風險—基金投資於新興市場，或會涉及更高風險以及投資於較成熟的市場時一般不會涉及之特殊考慮因素，例如流動性風險、貨幣風險/管制、政治及經濟不明朗因素、法律及稅務風險、結算風險、託管風險，以及可能出現大幅波動。若干亞洲國家可能被視為新興市場國家。新興市場之會計、審計及財務申報標準可能不如國際標準嚴格。國有化、徵

【附件三】本次變更前後對照表與相關風險

用私產或充公性稅項、外匯管制、政治變動、政府規例、社會不穩定或外交發展均有可能對新興市場經濟或基金之投資價值構成不利影響。

亞洲地區若干股票市場的較高市場波幅及潛在結算困難亦可能導致在該等市場交易的證券之價格出現大幅波動，因此可能對基金的價值造成不利影響。

3.集中風險—基金集中投資於亞洲（日本除外）。投資者應注意基金相比更廣泛分散投資的基金較為波動。基金的價值可能較容易受到影響該地區的不利經濟、政治、政策、外匯、流動性、稅務、法律或監管事件所影響。

4.避險風險—基金管理機構及投資經理人獲准有絕對自由裁量權（但並非必須）採用避險方法以嘗試減低市場及貨幣風險。不保證該等避險方法（如採用）將會達到預期之效果或該等避險方法將獲得採用，在該等情形下，基金可能需承受現有之市場及貨幣風險，並可能受到不利影響。對匯率風險所作出的避險（如有）可能或未必高達基金資產之100%。

5.小型公司風險—由於中小型公司的流動性較低、較容易受經濟狀況轉變影響，以及未來增長前景亦較為不確定，所以股價可能會較大型公司更為波動。

為了確保基金的投資組合由生效日起符合新的投資目標及政策，基金管理機構將自112年12月14日起開始對基金的投資組合比重進行重新調整。在投資組合重新調整比重期間，基金可能無法達致其現有投資目標及政策。

投資組合內預計有85.24%的資產需要進行重新調整。與投資組合重新調整比重相關的交易成本（包括市場影響成本及差價成本）估計約為75,400美元（佔截至112年10月12日基金資產淨值的0.43%），將由基金承擔。有關投資組合重新調整比重進行時繼續持有基金的投資者將會受到影響。投資組合重新調整比重期間產生的實際開支可能超出上述估計，而在該情況下，超出的金額將由基金承擔。

另本基金的銷售文件已作出其他加強揭露及雜項修訂。

除上文所揭露者外，適用於本基金的特點及風險將不會受到任何影響，基金的運作及／或管理方式將不會發生任何變動。除上文所載上調管理費外，上述變更將不會導致管理基金的費用水平／成本發生任何變動。基金管理機構認為，上述變更將不會對基金現有投資者的權利或利益造成重大損害。

與上文所載變更相關的法律及其他行政成本估計約為44,000美元，將由基金承擔。

金融監督管理委員會 函

受文者：摩根證券投資信託股份有限公司(代表人唐德瑜先生)

發文日期：中華民國112年7月18日
發文字號：金管證投字第1120346935號
速別：普通件
密等及解密條件或保密期限：
附件：

主旨：所請貴公司代理之「摩根澳洲基金 (JPMorgan Australia Fund)」變更基金名稱為「摩根亞洲股票高息基金 (JPMorgan Asia Equity High Income Fund)」一案，同意照辦，並請依說明事項辦理，請查照。

說明：

- 一、依據貴公司112年6月17日摩信(112)發字第237號函辦理。
- 二、自基金名稱變更之日起1年內，請於投資人須知及公開說明書中譯本並列基金之新舊名稱。
- 三、貴公司及銷售機構應將更名情事通知投資人。
- 四、有關旨揭基金投資策略變動一節，請於致股東通知書中以顯著顏色或字體方式為相關說明或標註，使投資人得以瞭解本次變更內容，包含投資策略、基金費用、風險報酬等級，及本次變更相關的法律及其他行政成本由旨揭基金承擔。
- 五、貴公司應依境外基金管理辦法第12條第6項規定，於事實發生日起3日內經由本會指定之資訊傳輸系統 (www.fundclear.com.tw) 辦理公告，並將修正後之公開說明書中譯

本及投資人須知，依前揭辦法第37條及第39條之規定於修正後3日內辦理公告。

六、旨揭基金變更事宜尚須經註冊地主管機關核准，若該等主管機關嗣後有未同意旨揭變更事項之情事，請儘速向本會申報。

正本：摩根證券投資信託股份有限公司(代表人唐德瑜先生)

副本：中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會(代表人劉宗聖先生)、臺灣集中保管結算所股份有限公司(代表人林丙輝先生)、中央銀行

2023/02/18
交15:20章



訂



線