

駿利亨德森證券投資顧問股份有限公司 函

受文者：凱基商業銀行股份有限公司

發文日期：中華民國 108 年 11 月 28 日

發文字號：駿顧字第 20190112 號

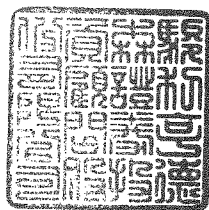
主旨：謹通知本公司總代理之駿利亨德森資產管理基金－駿利亨德森美國研究基金(下稱「本基金」)之公開說明書及投資人須知更新與修訂，詳如說明。

附件：駿利亨德森美國研究基金股東通知書及其中譯文

說明：

- 一、 公開說明書以羅素 1000 指數(下稱「參考指數」)(非央行於審查中採用之羅素 3000 指數)為本基金之績效比較基準，俾與本公司之年報內容一致。
- 二、 本公司投資組合中之產業類別權重擬維持與參考指數之產業類別權重相近，維持產業別權重與參考指數權重相近之目的在於透過自各產業類別高度積極選股達到(相對於參考指數之)高度風險貢獻，此即本公司相信本公司之基礎研究模式產生之風險調整後績效優於指標將達到最大化之處。
- 三、 本公司亦增訂長期年化後之每年績效於扣除費用前相對於參考指標超過至少 2% 為本基金之目標，反映投資顧問為主動管理。
- 四、 相關細節請詳見股東通知書及其中譯文。更新之中文版公開說明書及投資人須知，將於完成後上傳至境外基金資訊觀測站。

駿利亨德森證券投資顧問股份有限公司



(中文參考譯文，若中、英文版本的內容出現抵觸或歧異之處，將以英文版本之內容為準)

駿利亨德森資產管理基金
10 Earlfort Terrace
Dublin 2
愛爾蘭

2019年11月28日

親愛的股東：

主旨：駿利亨德森美國研究基金(下稱「本基金」)—募集文件更新與修訂

本公司已更新本基金之主要投資人資訊文件(KIID)與公開說明書，二者均可至本公司之網站 www.janjushenderson.com 取得。本公司係依歐洲證券與市場監理局(ESMA)就主要投資人資訊文件揭露事項新頒佈之準則與愛爾蘭中央銀行(下稱「央行」)對業界超過2,500檔愛爾蘭 UCITS 基金進行分析查核所提出之意見，更新該等文件。央行之查核採用下列三項門檻值以分析一檔基金對應指標指數之走勢:追蹤誤差 $<3.5\%$ 、貝他(Beta)落於0.9-1.1間、及判定係數(R^2) >0.9 。央行採用該等衡量指標後發現本基金長期績效走勢與羅素3000指數呈現高度一致性。因本基金達到央行所訂之門檻，央行對本基金進行詳細審查。基於該審查，本公司依央行要求更新本基金之公開說明書與主要投資人資訊文件如下：

1. 公開說明書以羅素1000指數(下稱「參考指數」)(非央行於審查中採用之羅素3000指數)為本基金之績效比較基準，俾與本公司之年報內容一致。
2. 本公司已闡明本公司投資組合中之產業類別權重擬維持與參考指數之產業類別權重相近，本參考指數代表以資本加權為基礎之廣大美國股權市場。為前開目的本公司採用本公司專有之產業別定義，而非參考指數提供者之產業別定義。維持產業別權重與參考指數權重相近之目的在於透過自各產業類別高度積極選股達到(相對於參考指數之)高度風險貢獻，此即本公司相信本公司之基礎研究模式產生之風險調整後績效優於指標將達到最大化之處。

本公司亦增訂長期年化後之每年績效於扣除費用前相對於參考指標超過至少2%為本基金之目標，反映投資顧問為主動管理。

本公司期望上述資訊對台端有所助益。

若有適用，請將本文件之內容轉知本基金之受益人。

敬祝 商祺

董事
代表
駿利亨德森資產管理基金