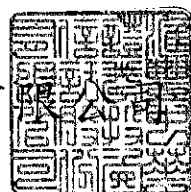


滙豐中華證券投資信託股份有



函

地 址
聯絡電話
聯 絡 人

受文者：各境內基金銷售機構

發文日期：中華民國111年2月9日

發文字號：(111)華金字第1110029號

速別：速件

密等及解密條件或保密期限：非密件

主旨：謹通知本公司經理之滙豐 ESG 永續多元資產組合證券投資信託基金(以下稱「滙豐 ESG 永續多元資產組合基金」)配合 ESG 相關主題基金之資訊揭露事項修訂公開說明書，另修訂「臨時性假日」定義，業經金管會准予備查。

說明：

- 一、 依金管會 111 年 2 月 8 日金金管證投字第 1100374089 號函准予備查。本次修訂內容將於公告後隔日生效（生效日為 111 年 2 月 10 日）。
- 二、 滙豐 ESG 永續多元資產組合基金公開說明書修訂前後條文對照表，詳列如下：

條次	修正後內容	原內容
封面 注意事項： 二、	本基金因計價幣別不同，投資人申購之受益權單位數，於本基金成立日前，為該申購幣別金額除以面額計。於召開受益人會議時，各計價幣別受益權單位每受益權單位有一表決權，不因投資人取得各計價幣別每受益權單位之成本不同而異。受益人不得申請於經理公司同一基金或不同基金新臺幣計價受益權單位與外幣計價受益權單位間之轉換。	本基金因計價幣別不同，投資人申購之受益權單位數，於本基金成立日前，為該申購幣別金額除以面額計。於召開受益人會議時，各計價幣別受益權單位每受益權單位有一表決權，不因投資人取得各計價幣別每受益權單位之成本不同而異。受益人不得申請本基金與經理公司其他基金間之轉申購，或本基金不同計價幣別受益權單位間之轉換。
封面 注意事項： 六	本基金之主要投資風險包括產業景氣循環風險、流動性風險、外匯管制及匯率變動之風險、投資地區政治、經濟變動之風險、投資特定投資標的等風險，另本基金得投資於非投資等級債券基金及新興市場債	本基金之主要投資風險包括產業景氣循環風險、流動性風險、外匯管制及匯率變動之風險、投資地區政治、經濟變動之風險、投資特定投資標的等風險，另本基金得投資於高收益債券基金及新興市場債券基

條次	修正後內容	原內容
	券基金，非投資等級債券基金之投資標的涵蓋低於投資等級或無信評之債券，故需承受較大之價格波動，新興市場債券基金因投資政治、經濟相對較不穩定之新興市場國家之債券，該等債券對利率風險和信用風險呈現較敏感的價格反應，而使其淨值波動較大。 下(略)	金，高收益債券基金之投資標的涵蓋低於投資等級或無信評之債券，故需承受較大之價格波動，新興市場債券基金因投資政治、經濟相對較不穩定之新興市場國家之債券，該等債券對利率風險和信用風險呈現較敏感的價格反應，而使其淨值波動較大。 下(略)
封面 注意事項： 八、	適合之投資人屬性：本基金為組合型基金，主要投資全球ESG、永續或責任投資之基金受益憑證、基金股份、投資單位，投資區域涵蓋全球且長期配置於債券子基金部位為50%以上，適合非保守型投資人，<u>納入其投資組合，投資人宜斟酌個人之風險承擔能力及資金之可運用期間長短後辦理投資。</u>	適合之投資人屬性：本基金為組合型基金，主要投資全球ESG、永續或責任投資之基金受益憑證、基金股份、投資單位，投資區域涵蓋全球且長期配置於債券子基金部位為50%以上，故本基金之風險報酬等級為RR3。此等級分類係基於一般市場狀況反映市場價格波動風險，無法涵蓋所有風險，不宜作為投資唯一依據，投資人仍應注意所投資基金個別之風險。
封面 注意事項： 九、	本公司聲明遵循集團對於環境、社會和治理（ESG）及社會責任投資策略(SRI)的政策，投資人可至本公司網站https://www.assetmanagement.hsbc.com.tw查詢相關盡職治理守則。	(新增)
壹、一、 (十)投資特色及投資策略	2. 投資策略： 本基金係以追求長期穩定的總回報為目標，經理人將運用策略資產配置與戰略資產配置，以股票子基金、債券子基金及現金等多元資產類別進行資產配置。 (1)至(2)(略) (3)ESG 子基金均應同時符合 A、B 與 C 三項所述之篩選原則： B. 基金經理根據子基金之公開資訊，包括但不限於公開說明書、定期報告等，將子基金或其於公開文件所揭露之追蹤基準	2. 投資策略： 本基金係以追求長期穩定的總回報為目標，經理人將運用策略資產配置與戰略資產配置，以股票子基金、債券子基金及現金等多元資產類別進行資產配置。 (1)至(2)(略) (3)ESG 子基金均應同時符合 A、B 與 C 三項所述之篩選原則： B. 基金經理根據子基金之公開資訊，包括但不限於公開說明書、定期報告等，將子基金或其於公開文件所揭露之追蹤基準

條次	修正後內容	原內容
	(benchmark)、所述之投資策略、投資組合建構原則等，屬於全球可持續投資聯盟(GSIA)定義之永續投資策略主題之一。GSIA定義之永續投資策略分別如下： (B)負面篩選：子基金之投資排除對環境、社會或治理(ESG)有負面影響的標的。 <u>以避免投資於罪惡股票(sin stocks)</u> ，例如煙草、武器、賭博商、軍火商及成人娛樂等類別。	(benchmark)、所述之投資策略、投資組合建構原則等，屬於全球可持續投資聯盟(GSIA)定義之永續投資策略主題之一。GSIA定義之永續投資策略分別如下： (B)負面篩選：子基金之投資排除對環境、社會或治理(ESG)有負面影響的標的。
壹、一、 (十一)本基金適合之投資人屬性分析	本基金為組合型基金，主要投資於全球 ESG、永續或責任投資之基金受益憑證、基金股份、投資單位，投資區域涵蓋全球且長期配置於債券子基金部位為 50%以上，適合非保守型投資人，納入其投資組合，投資人宜斟酌個人之風險承擔能力及資金之可運用期間長短後辦理投資。	本基金為組合型基金，主要投資於全球 ESG、永續或責任投資之基金受益憑證、基金股份、投資單位，投資區域涵蓋全球且長期配置於債券子基金部位為 50%以上，故依據「 <u>中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會基金風險報酬等級分類標準</u> 」風險報酬等級之分類為 RR3，適合非保守型投資人，納入其投資組合。 (基金風險報酬等級依基金投資標的風險屬性和投資地區市場狀況，由低至高編製為「RR1, RR2, RR3, RR4, RR5」五個風險報酬等級。)惟本基金風險報酬等級僅供參考，不得作為投資唯一依據，投資人宜斟酌個人之風險承擔能力及資金之可運用期間長短後辦理投資。
壹、一、 (二十一)基金營業日之定義	2. 臨時性假日： 「臨時性假日」係指本基金投資比重達淨資產價值一定比例（百分之 <u>三十</u> ）之主要投資所在國或地區如因颱風、天災或其他不可抗力之因素，致該市場主要交易所有下列情事者而被認定為本基金臨時性假日者，即為非基金營業日，經理公司應於知悉該等情事起兩個營業日內於經理公司網站公告。 (1) 若主要交易所宣佈該日全天停止交易，即適用「臨時性假日」之處理原則。 (2) 若主要交易所宣佈停止開	2. 臨時性假日： 「臨時性假日」係指本基金投資比重達淨資產價值一定比例（百分之 <u>二十</u> ）之主要投資所在國或地區如因颱風、天災或其他不可抗力之因素，致該市場主要交易所有下列情事者而被認定為本基金臨時性假日者，即為非基金營業日，經理公司應於知悉該等情事起兩個營業日內於經理公司網站公告。 (1) 若主要交易所宣佈該日全天停止交易，即適用「臨時性假日」之處理原則。 (2) 若主要交易所宣佈停止開

條次	修正後內容	原內容
	盤，但可能視情況恢復交易，可先行啟動「臨時性假日」之預備機制；惟之後若其恢復交易，該日仍視為該市場之正常營業日，不適用「臨時性假日」之處理原則。 (3) 若該交易所當日為正常開盤，但其後因臨時性之狀況停止交易（提早收盤），仍視同該日為該市場之一般營業日，不適用「臨時性假日」之處理原則。	盤，但可能視情況恢復交易，可先行啟動「臨時性假日」之預備機制；惟之後若其恢復交易，該日仍視為該市場之正常營業日，不適用「臨時性假日」之處理原則。 (3) 若該交易所當日為正常開盤，但其後因臨時性之狀況停止交易（提早收盤），仍視同該日為該市場之一般營業日，不適用「臨時性假日」之處理原則。
壹、五、投資風險之揭露	本基金之主要投資風險包括產業景氣循環風險、流動性風險、外匯管制及匯率變動之風險、投資地區政治、經濟變動之風險、投資特定投資標的等風險，另本基金得投資於非投資等級債券基金及新興市場債券基金，非投資等級債券基金之投資標的涵蓋低於投資等級或無信評之債券，故需承受較大之價格波動，新興市場債券基金因投資政治、經濟相對較不穩定之新興市場國家之債券，該等債券對利率風險和信用風險呈現較敏感的價格反應，而使其淨值波動較大。本基金投資內容涉及新興市場部分，因其波動性與風險程度可能較高，且其政治與經濟情勢穩定度可能低於已開發國家，也可能使資產價值受不同程度之影響。故本基金之風險報酬等級之分類為RR3(註) (註)風險報酬等級為本公司依照投信投顧公會「基金風險報酬等級分類標準」編製，該分類標準係計算過去5年基金淨值波動度標準差，以標準差區間予以分類等級，分類為RR1-RR5五級，數字越大代表風險越高。此等級分類係基於一般市場狀況反映市場價格波動風險，無法涵蓋所有風險(如：基金計價幣別匯率風險、投資標的產業風險、信用風險、利率風險、流動性風險等)，不宜作為投資唯一依據，	(新增)

條次	修正後內容	原內容
	投資人仍應注意所投資基金個別 的風險。 請投資人注意申購基金前應詳閱 公開說明書，充分評估基金投資 特性與風險，更多基金評估之相 關資料(如年化標準差、Alpha、 Beta 及 Sharpe 值等)可至投信投 顧公會網站之「基金績效及評估 指 標 查 詢 專 區」 (https://www.sitca.org.tw/index_pc.aspx)查詢。	
壹、五、 (八) 其他 投資標的或 特定投資策 略之風險	5. <u>非投資等級債券</u>基金風險： 本基金在可控制的風險範圍內， 將投資於<u>非投資等級債券</u>基金， 所謂<u>非投資等級債券</u>指的是信用 評等較差的企業所發行的高收益 率債券，由於債券信用評等較 差，因此違約風險較高，雖然該 類型的基金預期報酬較高，惟投 資人應注意其投資之風險包括利 率風險、債信風險及違約風險 等。	5. 高收益債券基金風險：本基金 在可控制的風險範圍內，將投資 於高收益債券基金，所謂高收益 債券指的是信用評等較差的企業 所發行的高收益率債券，由於債 券信用評等較差，因此違約風險 較高，雖然該類型的基金預期報 酬較高，惟投資人應注意其投資 之風險包括利率風險、債信風險 及違約風險等。
伍、五、其 他金管會規 定應特別記 載之事項	【附錄八】投信事業發行環境、 社會與治理(ESG)相關主題基金 之資訊揭露 (略)	(新增)

- 三、 敬請 貴行惠予配合辦理變更基金相關資訊，並轉知相關單位。
- 四、 其他未訂事宜，請參照基金公開說明書或雙方合約之規定辦理。

正本：臺灣銀行、臺灣土地銀行、合作金庫商業銀行、第一商業銀行、華南商業銀行、彰化商業銀行、上海商業儲蓄銀行、台北富邦商業銀行投資商品處、台北富邦銀行信託部、國泰世華商業銀行、兆豐國際商業銀行、臺灣中小企業銀行、匯豐銀行財富管理部、匯豐銀行基金作業部、法國巴黎銀行、臺灣新光商業銀行、元大商業銀行、玉山商業銀行、凱基銀行、星展(台灣)銀行財富管理部、星展(台灣)銀行信託部、中國信託商業銀行、基富通證券、中租投顧、鉅亨投顧、凱基證券、元大證券

董事長何慧芬

檔 號：

保存年限：

金融監督管理委員會 函

地
承
電
傳

受文者：滙豐中華證券投資信託股份有限公司（代表人何慧芬女士）

發文日期：中華民國111年2月8日

發文字號：金管證投字第1100374089號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：

附件：

主旨：所報經理之「滙豐ESG永續多元資產組合證券投資信託基金」，配合ESG相關主題基金之資訊揭露事項，修正公開說明書內容一案，同意備查，請查照。

說明：

- 一、復本會證券期貨局案陳貴公司110年11月11日（110）華產字第1100205號函。
- 二、請依證券投資信託事業募集證券投資信託基金公開說明書應行記載事項準則第25條及本會93年11月11日金管證四字第0930005499號令規定，於本函送達之日起3日內，將修正後之公開說明書傳送至公開資訊觀測站。
- 三、有關旨揭基金特性及與永續相關重要發行資訊，請依本會110年7月2日金管證投字第1100362463號函規定，於各式文宣、銷售文件及貴公司網站充分揭露，俾利投資人瞭解。

正本：滙豐中華證券投資信託股份有限公司（代表人何慧芬女士）

副本：中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會（代表人張錫先生）、臺灣集中保管