中國信託投信
CTBC INVESTMENTS

中國信託證券投資信託股份有限公司 公告

中華民國 111 年 9 月 30 日

中信(投信)字第 11109212011 號

主旨：本公司總代理之「(盧森堡）法盛國際基金 I」(下稱「本傘型基金」)基金公開說明書之變更事項通知。

說明：

一、本次「(盧森堡）法盛國際基金 I」之公開說明書之主要調整如下：

(一) 2022 年 9 月 27 日生效：

1.影響(盧森堡)法盛國際基金 I-法盛訂閱經濟基金之投資政策修訂如下：

修訂後	修訂前
[...]為衡量所實施 ESG 方法之有效性，基金投資經理公司確保本子基金將具有優於其可投資範圍(以每週分數的 3 個月滾動平均值衡量)的 ESG 評等（於排除後者至少 20%之評等最差之證券後）。基金投資經理公司倚賴來自第三方提供者之數據以監控此評等升級方法。[...]	[...]為衡量所實施 ESG 方法之有效性，基金投資經理公司確保本子基金將永久地具有優於其基準指數(如下述)的 ESG 評等（於排除後者至少 20%之評等最差之證券後）。基金投資經理公司倚賴來自第三方提供者之數據以監控此評等升級方法。[...]

2.影響(盧森堡)法盛國際基金 I-法盛智慧安保基金之投資政策修訂如下：

修訂後	修訂前
[...]為衡量所實施 ESG 方法之有效性，基金投資經理公司確保本子基金將具有優於其可投資範圍(以每週分數的 3 個月滾動平均值衡量)的 ESG 評等（於排除後者至少 20%之評等最差之證券後）。基金投資經理公司倚賴來自第三方提供者之數據以監控此評等升級方法。[...]	[...]為衡量所實施 ESG 方法之有效性，基金投資經理公司確保本子基金將永久地具有優於其基準指數(如下述)的 ESG 評等（於排除後者至少 20%之評等最差之證券後）。基金投資經理公司倚賴來自第三方提供者之數據以監控此評等升級方法。[...]

3.更新「一般資訊」章節，以反映傘型基金章程之最後更新日期。

4.更新「基金服務提供者及董事會」章節中之傘型基金董事名單，以反映由 Emmanuel Chef 先生取代 Florian du Port de Poncharra 先生擔任董事一職之任命。

(二) 將於 2022 年 10 月 31 日生效：

修改以下子基金的投資政策，將環境、社會及公司治理(ESG)標準納入基金投資策略之一部。因此，如今這些基金將根據歐洲議會及理事會關於金融服務業之永續性相關揭露之(EU)2019/2088 法規被歸類為「第 8 條基金」：

・(盧森堡)法盛國際基金 I-法盛亞太股票基金

・(盧森堡)法盛國際基金 I-法盛盧米斯賽勒斯投資等級債券基金

上述投資政策的變更也將使各子基金章節中新增下述「特別風險」:「ESG 驅動投資」及「地域集中性」。「永續性風險」章節已經修訂，將永續性風險納入 ESG 方法的一部分。

於此背景下，股東應注意上述各子基金的投資政策將受到以下影響。

1.(盧森堡)法盛國際基金 I-法盛亞太股票基金：

基金投資經理公司依據例如品牌、管理及財務報表之品質及 ESG（環境、社會及公司治理）考量因素等特性選取股票，同時就該股票之中長期成長提供可見且具持續性之觀點。隨後依自有的評價工具決定之預期上升潛力調整股票之購買。

關於 ESG 考量因素，基金投資經理公司使用自有的 ESG 模型進行分析。就每家公司皆會評價定量與定性之指標。定量資訊乃透過 ESG 數據提供商及公司提供之財務外報告獲得。定性評估乃基於事實資訊及與公司管理層之面談。更具體地說，ESG 考量因素包括但不限於以下標準：

・環境標準：生產鏈與產品生命週期中的環境足跡、負責任之供應鏈、能源及水之消耗、二氧化碳及廢物排放之管理。

・社會標準：整個生產鏈中的道德和工作條件、員工待遇，例如安全、福利、多元、員工代表、工資，以及提供之產品或服務之品質。

・公司治理標準：資本結構及對少數權益之保護、董事會及管理階層、管理階層之報酬、會計使用及財務風險、道德。

2.(盧森堡)法盛國際基金 I-法盛盧米斯賽勒斯投資等級債券基金：

本子基金將促進氣候變遷減緩之環境特徵(下稱「特徵」)，透過將部分資產投資於符合本特徵之發行人所發行之債務證券(例如綠色債券)。

作為本子基金投資決策過程之關鍵組成部分，基金投資經理公司將於選擇證券時採用以下方法：

(1)創設綜合分數：基金投資經理公司利用自有之 ESG 框架對於來自外部供應商之數據進行分析，及透過內部的特定行業重要性圖表進行內部分析，用以根據指定之 ESG 標準為每位發行人產生個別之分數。此自有之 ESG 框架對本子基金超過 90%之淨資產價值進行非財務分析。這些分數將用於計算行業相關之 ESG 分數，以 1 遞減（高於行業平均水平）；2（行業平均水平）；及 3（低於行業平均水平）。

(2)篩選投資範圍：

基金投資經理公司將最多本子基金淨資產之 10%投資於 ESG 分數為 3 分之發行人。本子基金僅將投資於經積極互動而能證實其在重大 ESG 議題有所改善之發行人。

基金投資經理公司將下列排除於本子基金之投資範圍之外：

a.出現在挪威中央銀行排除名單上之任何發行人；

b.被 MSCI 標記為最近涉入嚴重爭議、違反聯合國全球盟約所列十原則之其中一項或數項之任何發行人；及

c.根據 ISS-Ethix 爭議武器篩選評估，經辨識為從事集束彈藥與殺傷人員地雷之生產或銷售活動之任何發行人。

(3)於優化之投資範圍中選擇證券：基金投資經理公司隨後將根據額外之 ESG 考慮因素，進一步分析剩餘之投資範圍，以辨識與選擇符合以下條件之發行人：

a.促進特徵；

b.遵循良好之治理實務。

二、自公告之日起至生效日止，股東得要求贖回或轉換其股份而無須支付贖回費用(依公開說明書之定義)。

三、檢附中英文「致股東通知函」。

致股東通知函(中文版)　　**致股東通知函(英文版)**