

瀚亞證券投資信託股份有限公司

瀚亞全球高收益債券證券投資信託基金

公告

中華民國 108 年 5 月 14 日 (108) 瀚亞字第 0257 號

主旨：本公司經理之「瀚亞全球高收益債券證券投資信託基金」變更海外投資業務複委任受託管理機構為 M&G Investment Management Limited.(以下簡稱 M&G)暨修訂證券投資信託契約，特此公告。

公告事項：

- 一、依據金管會 108 年 3 月 28 日金管證投字第 1080307043 號函辦理公告。
- 二、旨揭基金業經金管會核准修訂證券投資信託契約，變更海外投資業務複委任受託管理機構為 M&G，並明定得投資無到期日次順位債券、得為增加投資效率目的從事匯率遠期交易(含無本金遠期交易)及匯率交換契約、得為避險或增加投資效率目的從事信用違約交換指數交易。
- 三、前揭證券投資信託契約修訂條文之生效日訂於 108 年 6 月 19 日。
- 四、信託契約之修訂前後條文對照表如下，修正後之公開說明書請至公開資訊觀測站 (<http://mops.tse.com.tw>) 及本公司網站 (<https://www.eastspring.com.tw>) 查詢。

瀚亞全球高收益債券證券投資信託基金

證券投資信託契約修正對照表

條	項	款	修正後條文	條	項	款	原條文	說明
第一條			定義	第一條			定義	
1	1	40	受託管理機構：指 <u>M&G Investment Management Limited.</u> ，依其與經理公司間海外投資業務複委任契約暨本基金投資所在國或地區相關法令規定，受經理公司複委任管理本基金國外投資業務之公司。	1	1	40	受託管理機構：指 <u>PPM America, Inc.</u> ，依其與經理公司間海外投資業務複委任契約暨本基金投資所在國或地區相關法令規定，受經理公司複委任管理本基金國外投資業務之公司。	本基金擬更換複委任受託管理機構為 M&G Investment Management Limited。
第十四條			運用本基金投資證券及從事	第十四條			運用本基金投資證券及從事	

			證券相關商品交易之基本方針及範圍				證券相關商品交易之基本方針及範圍	
14	1	1	本基金投資於中華民國之政府公債、公司債(含次順位公司債、無到期日次順位公司債、轉換公司債、附認股權公司債及交換公司債)、金融債券(含次順位金融債券、無到期日次順位金融債券)、承銷中之公司債、經金管會核准於我國境內募集發行之國際金融組織債券、固定收益型、債券型及貨幣市場型證券投資信託基金受益憑證、依金融資產證券化條例公開招募之受益證券或資產基礎證券、依不動產證券化條例募集之不動產資產信託受益證券。	14	1	1	本基金投資於中華民國之政府公債、公司債(含次順位公司債、轉換公司債、附認股權公司債及交換公司債)、金融債券(含次順位金融債券)、承銷中之公司債、經金管會核准於我國境內募集發行之國際金融組織債券、固定收益型、債券型及貨幣市場型證券投資信託基金受益憑證、依金融資產證券化條例公開招募之受益證券或資產基礎證券、依不動產證券化條例募集之不動產資產信託受益證券。	明定本基金得投資於無到期日次順位債券。
14	1	2	本基金投資之外國有價證券，包括： 1. 由外國政府或機構所保證或發行之債券(含政府公債、公司債(含次順位公司債、無到期日次順位公司債)、符合美國 Rule 144A 規定之債券、轉換公司債、附認股權公司債、交換公司債、金融債券(含次順位金融債券、無到期日次順位金融債券)、金融資產證券化之受益證券或資產基礎證券、不動產資產信託受益證券及具有相當於債券性質之有價證券)。 2. 於外國證券交易所及其他經金管會核准之外國店頭市場交易之固定收益型、債券型或貨幣市場型基金受益憑證、基金股份、投資單位(含 ETF(Exchange Traded Fund))	14	1	2	本基金投資之外國有價證券，包括： 1. 由外國政府或機構所保證或發行之債券(含政府公債、公司債、符合美國 Rule 144A 規定之債券、轉換公司債、附認股權公司債、交換公司債、金融債券、金融資產證券化之受益證券或資產基礎證券、不動產資產信託受益證券及具有相當於債券性質之有價證券)。 2. 於外國證券交易所及其他經金管會核准之外國店頭市場交易之固定收益型、債券型或貨幣市場型基金受益憑證、基金股份、投資單位(含 ETF(Exchange Traded Fund))	同上。

		及反向型 ETF)。 3. 經金管會核准或生效得募集及銷售之外國基金管理機構所發行或經理之固定收益型、貨幣市場型或債券型基金受益憑證、基金股份或投資單位(含 ETF(Exchange Traded Fund))。			及反向型 ETF)。 3. 經金管會核准或生效得募集及銷售之外國基金管理機構所發行或經理之固定收益型、貨幣市場型或債券型基金受益憑證、基金股份或投資單位(含 ETF(Exchange Traded Fund))。	
14	5	經理公司運用本基金為公債、公司債(含次順位公司債、 <u>無到期日次順位公司債</u> 、轉換公司債、附認股權公司債及交換公司債)或金融債券(含次順位金融債券、 <u>無到期日次順位金融債券</u>)投資，應以現款現貨交易為之，並指示基金保管機構辦理交割。	14	5	經理公司運用本基金為公債、公司債(含次順位公司債、轉換公司債、附認股權公司債及交換公司債)或金融債券(含次順位金融債券)投資，應以現款現貨交易為之，並指示基金保管機構辦理交割。	同上。
14	7	經理公司得為避險之目的，從事換匯、遠期外匯、換匯換利交易及新臺幣對外幣間匯率選擇權及外幣間匯率避險等交易(Proxy hedge)(含換匯、遠期外匯、換匯換利及匯率選擇權)， <u>且於交易範圍不涉及新臺幣之情形下，得為增加投資效率之目的，從事匯率遠期交易(含無本金遠期交易)及匯率交換契約。前述為避險目的及為增加投資效率目的所從事之交易</u> ，並應符合中華民國中央銀行或金管會之相關規定，如因有關法令或相關規定修改者，從其規定。本基金所從事之外幣間匯率選擇權及外幣間匯率避險交易係以直接購買銀行所提供之二種外幣間或一籃子(Proxy	14	7	經理公司得為避險之目的，從事換匯、遠期外匯、換匯換利交易及新臺幣對外幣間匯率選擇權及外幣間匯率避險等交易(Proxy hedge)(含換匯、遠期外匯、換匯換利及匯率選擇權)，並應符合中華民國中央銀行或金管會之相關規定，如因有關法令或相關規定修改者，從其規定。本基金所從事之外幣間匯率選擇權及外幣間匯率避險交易係以直接購買銀行所提供之二種外幣間或一籃子(Proxy basket hedge)外幣間之遠期外匯或選擇權來進行。本基金於從事遠匯或換匯交易之操作時，其金額與期間，不得超過以外國貨幣計價資產之價位與期間。	明定本基金得為增加投資效率目的，從事匯率遠期交易及匯率交換契約。

			basket hedge)外幣間之遠期外匯或選擇權來進行。本基金於從事遠匯或換匯交易之操作時，其金額與期間，不得超過以外國貨幣計價資產之價位與期間。					
14	8	9	投資於任一公司所發行公司債（含次順位公司債、 <u>無到期日次順位公司債</u> ）之總金額，不得超過本基金淨資產價值之百分之十；投資於任一公司所發行次順位公司債或 <u>無到期日次順位公司債</u> 之總額，不得超過該公司該次（如有分券指分券後）所發行次順位公司債或 <u>無到期日次順位公司債</u> 總額之百分之十； <u>所投資之無到期日次順位公司債應以國內外之銀行業、票券業、信託業、保險業、證券業、期貨業或金融控股公司等金融機構募集發行者為限；</u>	14	8	9	投資於任一公司所發行公司債（含次順位公司債）之總金額，不得超過本基金淨資產價值之百分之十；投資於任一公司所發行次順位公司債之總額，不得超過該公司該次（如有分券指分券後）所發行次順位公司債總額之百分之十；	明定本基金投資於無到期日次順位債券之相關投資限制。
14	8	11	投資於任一銀行所發行之金融債券（含次順位金融債券、 <u>無到期日次順位金融債券</u> ）之總金額，不得超過本基金淨資產價值之百分之十，及該銀行所發行金融債券總額之百分之十；投資於任一銀行所發行次順位金融債券或 <u>無到期日次順位金融債券</u> 之總額，不得超過該銀行該次（如有分券指分券後）所發行次順位金融債券或 <u>無到期日次順位金融債券</u> 總額之百分之十； <u>所投資之無到期日次順位金融債券應以國內外之銀行業、票券業、信託</u>	14	8	11	投資於任一銀行所發行之金融債券（含次順位金融債券）之總金額，不得超過本基金淨資產價值之百分之十，及該銀行所發行金融債券總額之百分之十；投資於任一銀行所發行次順位金融債券之總額，不得超過該銀行該次（如有分券指分券後）所發行次順位金融債券總額之百分之十；	同上。

			業、保險業、證券業、期貨業或金融控股公司等金融機構募集發行者為限；				
14	8	12	投資於無到期日次順位債券總金額，不得超過本基金淨資產價值之百分之十，並應以國內外之銀行業、票券業、信託業、保險業、證券業、期貨業或金融控股公司等金融機構募集發行者為限；			本款新增，其後款次依序調整。	依據107年8月3日金管證投字第1070327025號函規定，明定投資於無到期日次順位債券之限制。
14	11		經理公司從事衍生自信用相關金融商品交易應遵守下列規定，惟如有關法令另有規定或修正者，從其規定： (一)本基金得為避險之目的作為信用保護的買方，承作衍生自信用相關金融商品交易（即信用違約交換(CDS)及信用違約交換指數(CDS Index，如 CDX 系列指數與 Itraxx 系列指數等)交易)。 (二)本基金得為增加投資效率之目的，承作信用違約交換指數(CDS Index，如 CDX 系列指數與 Itraxx 系列指數等)交易。 (三)與經理公司從事衍生自信用相關金融商品交易之交易對手，除不得為經理公司之利害關係人外，如該交易係於店頭市場且未經第三方結算機構方式為之者，並應符合下列任一信用評等機構評定之長期發行人信用評等等級： 1. 經 Standard & Poor's Corporation 評定，長期債務信用評等達 BBB-級（含）	14	11	本項新增。	明定本基金得為避險或增加投資效率目的，從事信用違約交換指數(CDS Index)交易，暨相關投資限制。

		以上，短期債務信用評等達 A-3 級（含）以上者；或 2. 經 Moody ' s Investors Service 評定，長期債務信用評等達 Baa3 級（含）以上，短期債務信用評等達 P-3 級（含）以上者；或 3. 經 Fitch Ratings Ltd. 評定，長期債務信用評等達 BBB-級（含）以上，短期債務信用評等達 F3 級（含）以上者；或 4. 經中華信用評等股份有限公司評定，長期債務信用評等達 twBBB-級（含）以上，短期債務信用評等達 twA-3 級（含）以上者；或 5. 經澳洲商惠譽國際信用評等股份有限公司台灣分公司評定，長期債務信用評等達 BBB-（tw）級（含）以上，短期債務信用評等達 F3（tw）級（含）以上者。 （四）有關本基金承作衍生自信用相關金融商品交易之控管措施、相關風險及投資釋例詳公開說明書。 （五）本基金為增加投資效率從事信用違約交換指數交易，其名目本金之總和應併計入其他為增加投資效率從事之證券相關商品交易之總市值及總名目價值，其合計總金額不得超過本基金淨資產價值之百分之四十。				
--	--	--	--	--	--	--