

華南永昌證券投資信託股份有限公司公告

中華民國 109 年 11 月 26 日

華永信字第 1090000389 號

主旨：本公司經理之「華南永昌低波動多重資產證券投資信託基金」(以下簡稱本基金)修訂公開說明書之投資策略乙案，業經金融監督管理委員會(以下簡稱金管會)核備，特此公告。

說明：

- 一、本案業經金管會 109 年 11 月 20 日金管證投字第 1090375690 號函核准。
- 二、考量基金操作彈性及為擴大基金投資參考範圍以增加投資機會，本基金修訂公開說明書之股票、債券投資策略。本次修訂事項不涉及基金投資基本方針及產品定位之變更，自公告日之翌日起生效適用。
- 三、本次公開說明書修訂對照表如下，修訂後之公開說明書可於公開資訊觀測站 (<http://mops.twse.com.tw>)及本公司網站(<http://www.hnfunds.com.tw>)下載。

華南永昌低波動多重資產基金公開說明書修訂條文對照表

條項	修訂後	修訂前
十、投資策略及特色之重點摘述 (一)投資策略	<p>1.原則上，本基金投資組合以股票、債券、基金受益憑證(含ETF)為建構方向，投資策略主要透過低波動股票、政府公債及選擇權之資產組合配置，以達到跟隨指數上漲、較佳的下跌保護力、降低資產組合波動度及風險等投資目標。在控制投資組合波動目標下，將每日檢視並伺機調整股票及固定收益之部位配置比重。</p> <p>2.股票投資策略：本基金股票配置比重0%~70%，股票篩選參考標普500低波動指數(S&P 500 Low Volatility Index)成分股，由投資團隊檢視个股基本面，決定投資標的及權重。</p> <p>3.債券投資策略：本基金債券比重最高不超過70%，債券策略主要投資於成熟國家政府公債，藉由公債之高安全性、低波動等特性與優勢，以達到降低市場下跌時投資風險之效益。<u>另也會依市場狀況，檢視投資等級債的投資機會。</u></p> <p>4.基金受益憑證(含ETF)投資策略：基</p>	<p>1.原則上，本基金投資組合以股票、債券、基金受益憑證(含ETF)為建構方向，投資策略主要透過低波動股票、政府公債及選擇權之資產組合配置，以達到跟隨指數上漲、較佳的下跌保護力、降低資產組合波動度及風險等投資目標。在控制投資組合波動目標下，將每日檢視並伺機調整股票及固定收益之部位配置比重。</p> <p>2.股票投資策略：本基金股票配置比重0%~70%，股票篩選參考<u>BNP Paribas美國低波動指數(BNP Paribas Equity Low Vol US Index)</u>成分股，由投資團隊檢視个股基本面，決定投資標的及權重。</p> <p>3.債券投資策略：本基金債券比重最高不超過70%，債券策略主要投資於成熟國家政府公債，藉由公債之高安全性、低波動等特性與優勢，以達到降低市場下跌時投資風險之效益。</p> <p>4.基金受益憑證(含ETF)投資策略：基</p>

條項	修訂後	修訂前
	<p>於流動性因素、分散標的風險、降低交易成本及靈活執行或調整投資組合需求等考量，本基金將彈性佈局於基金受益憑證，單一基金受益憑證不超過本基金淨資產價值20%。</p> <p>5.為控制資產組合波動度，本基金將搭配投資於衍生自股價指數或指數股票型基金(ETF)之選擇權，透過買進選擇權賣權策略，提供投資組合下檔保護支撐，強化投資組合抵禦下跌風險的能力。</p>	<p>交易成本及靈活執行或調整投資組合需求等考量，本基金將彈性佈局於基金受益憑證，單一基金受益憑證不超過本基金淨資產價值20%。</p> <p>5.為控制資產組合波動度，本基金將搭配投資於衍生自股價指數或指數股票型基金(ETF)之選擇權，透過買進選擇權賣權策略，提供投資組合下檔保護支撐，強化投資組合抵禦下跌風險的能力。</p>