

華南永昌證券投資信託股份有限公司

公告

中華民國 112 年 9 月 6 日
華永信字第 1120000265 號

主旨：本公司所經理之「華南永昌全球精品證券投資信託基金」（以下簡稱本基金）修正公開說明書相關內容，業經金融監督管理委員會（以下簡稱金管會）核准，特此公告。

公告事項：

- 一、 依據本基金信託契約第 31 條規定辦理公告。
- 二、 本基金業經金管會中華民國 112 年 9 月 5 日金管證投字第 1120354972 號函核准在案，調整本基金投資策略並修正公開說明書。
- 三、 本基金之公開說明書修正前後對照表詳列如下，修正後之公開說明書可於本公司網站(<https://www.hnfunds.com.tw>)及公開資訊觀測站(<https://mops.twse.com.tw>)查詢下載。

華南永昌全球精品基金證券投資信託基金公開說明書修正對照表

條項	修正後	條項	修正前	說 明
【基金概況】				
壹、基金簡介 十、投資策略及特色之重點 摘要 (一)本基金投資策略： 3. 投資決策流程	(4) 步驟 4：決定投資標的比重及建立投資組合 將步驟 3 所篩選出之投資標的放入投資組合中，並利用 <u>Bloomberg</u> 或公司研發之量化系統，去衡量每個投資標的加入組合中之風險。包含這個投資標的與投資組合中其他投資標的相關度、產業的比重、相對波動率、beta 值等。	壹、基金簡介 十、投資策略及特色之重點 摘要 (一)本基金投資策略： 3. 投資決策流程	(4) 步驟 4：決定投資標的比重及建立投資組合 將步驟 3 所篩選出之投資標的放入投資組合中，並利用 <u>Vestek</u> 或 <u>Barra</u> 系統，去衡量每個投資標的加入組合中之風險。包含這個投資標的與投資組合中其他投資標的相關度、產業的比重、相對波動率、beta 值等， <u>透過這些量化指標決定出最適投資比重。然而在風險</u>	1. 公司目前未配備 Vestek 及 Barra 系統，擬由 Bloomberg 及公司自行開發之量化系統取代。 2. 本基金為

條項	修正後	條項	修正前	說 明
			<p>控管下，每檔股票之投資比重將控制 1.5%~4.0%間。</p> <p>(5) 步驟 5：利用追蹤誤差及因子分析控管風險</p> <p>■利用追蹤誤差(tracking error)有效控管基金與市場風險。</p> <p>■使用 Vestek 去定義及管理每一項因子的風險變動分析。</p> <p>■定期控管交易量(Trading volume)變化，以調整投資標的之持股比重。</p> <p>(6) 步驟 6：績效衡量及投資組合監控</p> <p>定時檢視投資組合之績效，並透過 <u>Bloomberg Portfolio OrderManagement System</u> 去監控投資組合之配置是否符合投資方針，以確保投資組合達到投資目標。</p>	<p>主動操作型基金，故刪除對單一個股 1.5%~4.0%之比重限制。</p> <p>3. 本基金為主動操作型基金，原(5)所述多使用於被動型基金，故刪除之。</p> <p>Bloomberg 目前已無相關功能，故改由基金檢討月報及投資週會檢討績效。</p>
	<p>(5) 步驟 5：績效衡量及投資組合監控</p> <p>定時檢視投資組合之績效，並透過<u>基金檢討月報及投資週會</u>去監控投資組合之配置是否符合投資方針，以確保投資組合達到投資目標。</p>			

四、 特此公告。