

參賽編號

F22002

區域

台灣

類別

全球新興市場股票

公司名稱

群益證券投資信託股份有限公司

旗艦基金名稱

群益新興金鑽基金

旗艦基金 ISIN 代碼

TW000T1605Y2

資料截至季末日

30/06/2021

基金總規模 (包括所有股份類別)

新台幣8.62億元

投資組合經理總數

1

分析師總數

10

支柱能力1：投資策略

1.

投資風格一致性：何者在任何條件與狀況下，對維持投資風格一致性負有最終責任。請選擇最接近的選項：

本策略的首席投資組合經理 (The lead portfolio manager/s of this strategy)

2.

投資風格一致性：若投資風格偏離，對於要負起確保風格一致的最終負責人而言，是否需承擔實質負面後果？

是的，有重大後果，對最終責任人有包括獎金減少、晉升凍結和/或具體財務後果 (Yes, there are material consequences, including bonus reduction, promotion freeze and/or specific financial consequences on the ultimately responsible individual)

3. 投資流程：投資過程是否包括以下任何一項。請選擇所有最適用的答案：

- *我們有清晰一致的投資流程 (We have a clear and consistent investment process)
- *我們有策略來確定目標投資者的風險/回報狀況 (We have the strategy to have a target investors' risk/return profile)
- *根據目標投資者的需求對投資領域進行初步篩選 (The initial screening of the investment universe account for target investors' needs)
- *我們的想法是自下而上的，例如深入研究潛在被投資公司的商業模式、護城河、未來現金流等 (We generate ideas from the bottom up, e.g., drilling down into a potential investee's business model, moat, future cash flow, etc.)
- *我們的想法來自宏觀角度，例如結構性轉變、經濟週期、體制變化、監管轉變等 (We generate ideas from macro views, e.g., structural shifts, economic cycles, regime change, regulatory shifts, etc.)
- *在研究、投資、撤資過程中的一個或多個點諮詢風險經理 (The risk managers are consulted at one or more points during the research, investment, divestment processes)

4. 您是否將ESG 視作投資/撤資的重要影響？

是的 (Yes)

環境

33

社會

33

公司治理

34

5. ESG 納入投資流程 [v]：ESG 信息是否應用於投資產品的投資流程或盡職治理活動？

是 (Yes)

已選：是

*作為投資經理，我們努力評估所使用的ESG資訊的可靠性，包括以下內容: (As investment managers, we allocate efforts to evaluate the reliability of the ESG information used, including the following:)

已選：作為投資經理，我們努力評估所使用的ESG資訊的可靠性，包括以下內容:

- *對被投資方報告或 ESG 數據提供商提供的信息進行獨立評估 (independent evaluation of information reported by investees or provided by ESG data providers)
- *交叉參考兩個或多個信息源 (cross-referencing two or more sources of information)
- *評估數據的準確性和完整性，以確定哪些來源和類型的 ESG 信息該應用在投資流程中 (evaluation of the accuracy or completeness of a dataset when determining the sources and types of ESG information that will be used in the investment process)
- *評估某些特定數據集的不確定性可能對投資決策帶來的影響 (evaluation of how inherent uncertainty in specific data sets might affect investment decisions)

6. 在確定 ESG 因素[v] [vi]

的重要性時，該策略是否考慮了以下因素：（匹配CFA的ESG披露要求和建議）

- *對投資產品目標或實現目標的可能性的影響程度 (The extent to which the materiality issue influences the objectives of the investment product or the likelihood of achieving them)
- *對投資領域的規模和特徵的影響程度 (The extent to which the materiality issue affects the size and characteristics of the investment universe)
- *對投資決策或投資過程的影響程度 (The extent to which the materiality issue affects investment decisions or the investment process)
- *對盡職治理活動的影響程度 (The extent to which the materiality issue affects stewardship activities)
- *吸引與現有投資者的需求偏好不同的潛在投資者的可能性 (The likelihood that the materiality issue would attract prospective investors with needs and preferences that differ from those of current investors)
- *是否觸發當地監管要求，如提交新文件，向監管機構更新現有文件，或向現有投資者提供新的或更新的披露信息 (Whether the materiality issue triggers a local regulatory requirement, such as filing new documents, updating existing documents with a regulator, or providing new or updated disclosures to current investors)
- *影響整個行業或地區的風險，包括公司所涉及的業務活動和/或其採購或銷售的市場相關的監管和技術變化 (Sector/geographic risk affecting an entire industry or region, including regulatory and technological changes associated with the business activity the company is involved in and/or to the markets it sources or sells to)
- *間接風險敞口，如資源稀缺導致貨幣政策收緊，流動性差可能導致投資損失 (Indirect exposure such as resource scarcity prompting a tightening monetary policy, poor liquidity could drive investment losses)

7. 對資本/資產市場結構性變化的反應：該投資策略如何為投資者的利益應對這些變化？

請選擇一個適用的答案：

我相信資本/資產市場已經發生了根本性的變化——波動性明顯比以前更大，因此： (I believe the capital/asset markets have changed fundamentally -- volatility is appreciably more significant than before, therefore:)

已選：我相信資本/資產市場已經發生了根本性的變化——波動性明顯比以前更大，因此：

我們已經製定或有具體[iiii] 計劃在未來 12 個月內製定以提高投資組合和/或證券級別的流動性 (We have instituted or have concrete[iiii] plans to institute within the next 12 months to improve liquidity at the portfolio and/or security levels)

8. 實例說明：請提供一個實際的例子來說明您如何執行下列選項之一，

投資組合在具有挑戰性的時期內保持投資風格的一致性 (Maintained investment style consistency during a particularly challenging time for the portfolio)

請以500字內簡要描述主要挑戰、採取的操作、結果和吸取的經驗：

投資邏輯會架構在相對應的指標上(Benchmark),因此當市場大幅波動時,基金的前十大持股並不會顯著改變,以維持投資風格一致性