

本函係重要文件，請您立即審閱。
如您對擬採取之行動有所疑義，應立即諮詢您的關係經理或其他專業顧問。

BlackRock Global Funds

貝萊德全球基金

西元2025年3月18日

親愛的股東，您好：

貝萊德提供業界最全面的永續產品範圍，基於客戶之需求及偏好，我們承諾持續強化我們的產品平台以協助客戶達成永續及轉型之投資目標。

謹以此函通知，我們將會持續強化部分基金，以依循歐洲證券及市場管理局（ESMA）對於使用ESG或永續相關字彙於基金名稱之新準則。

為實施新準則（現有基金應於2025年5月21日前實施），我們將透過以下三個關鍵原則來進行：

- ▶ 維持我們的永續投資方法之嚴謹性；
- ▶ 追求確保我們的產品持續依循客戶偏好；以及
- ▶ 追求避免任何可能帶給客戶負面影響的變更。

此準則對於使用如「永續」、「環境」和「影響」等字彙之基金將設立特定要求。對於相關基金，基本上應適用歐盟巴黎協定指標（PAB）排除法（廣泛禁止投資於從事爭議性武器或菸草之公司；或違反聯合國或全球盟約原則與經濟合作暨發展組織（OECD）跨國企業準則；或透過煤、石油、天然氣開採或發電事業賺取衍生性收益超過特定門檻）¹。

相同的，對於使用如「社會」、「治理」和「轉型」等字彙於名稱之基金，應適用歐盟氣候轉型指標（CTB）排除法（廣泛禁止投資於從事爭議性武器或菸草之公司；或違反聯合國或全球盟約原則與經濟合作暨發展組織（OECD）跨國企業準則）。

此外，任何使用ESG或永續相關字彙之基金應確保至少其投資之80%投資符合環境或社會目標或永續投資目標，如基金之規範所揭露。

當多數客戶表示其對於維持基金之現有投資流程以及客戶成果之偏好，我們將會修改基金名稱。為反映此客戶回饋對於新準則之遵守，相關基金將不會繼續使用ESG或永續相關字彙於名稱，但得維持基金專注於「社會」、「環境」及／或「治理」風險及機會之投資策略。此將清楚地列於基金文件。

貝萊德全球基金（下稱「本公司」）之董事會（下稱「董事會」或「董事」）謹此致函通知本公司部分子基金（下稱「相關基金」）擬於西元（下同）2025年5月6日（下稱「生效日」）生效之變更，以遵守新準則。

若欲獲取更多資訊或認識現行版本之公開說明書，您可以前往www.blackrock.com瀏覽相關訊息。

¹ 本基金可能出於非投資目的（透過包括但不限於衍生性商品和集體投資計劃之股份或單位）獲得對發行人之間接曝險，其曝險部位與所述之歐盟巴黎協定指標例外情況不一致。可能產生此類間接曝險之情況包括但不限於：基金投資的外國直接投資（“FDI”）之交易對手提供與基金ESG標準不一致之抵押品或基金投資之集體投資計劃（“CIS”）未應用與基金相同之ESG標準，因此提供與基金ESG標準不一致的證券曝險。

除本函第一節有關ESMA準則（下稱「**ESMA準則**」）實施之變更外，其他無關ESMA準則之實施將於本函第二節說明。

各基金修正之特定投資目標及政策之全面瞭解，請參考<https://www.blackrock.com/tw/document-centre?materialType=shareholder+letters&glsLanguage=zh>。

本函未定義之詞彙，其定義與現行有效之公開說明書（詳參www.blackrock.com）之定義相同。

有關ESMA準則之公開說明書變更

本節僅與ESMA準則之實施所影響公開說明書變更相關。

變更基金投資目標及政策之敘述

自生效日起，下列基金之投資策略將會導入或修改其某些特徵，以尋求確保ESMA準則實行後，相關基金遵守所適用之規範框架及ESMA準則。

除本節所述之ESMA新準則實施而導致之基金某些特徵變更以及此函所述之其他更新外，下方所列相關基金之ESG特徵及和承諾維持不變。

下方表格所列相關基金係為因應ESMA準則之實施而進行之變更。為方便閱讀，具有相同內容變更之基金列於同一欄位。

基金名稱	自生效日起之承諾
貝萊德環球動力股票基金（本基金非屬環境、社會及治理相關主題基金）	本基金之投資目標及政策已修訂如下： (i) 依ESMA準則之建議實施，本基金將採用PAB排除法； (ii) 永續投資之最低承諾自20%提高至50%。 本基金將持續被視為SFDR第8條定義所指具有「促進及/或社會環境特徵」，並依適用之法令規範，適用之契約前揭露（PCD）將自生效日起載於公開說明書附錄辛。
貝萊德新世代運輸基金（基金之配息來源可能為本金）	依ESMA新準則之建議實施，相關基金之投資目標及政策已修訂使相關基金將採用實施PAB排除法。 相關基金將持續具有SFDR第9條定義所指「永續目標」，並依適用之法令規範，適用之契約前揭露（PCDs）將自生效日起載於公開說明書附錄辛。
貝萊德永續能源基金（基金之配息來源可能為本金）	
貝萊德美國政府房貸債券基金	
貝萊德ESG社會責任多元資產基金（基金之配息來源可能為本金）	(i) 依ESMA準則建議之實施，本基金將採用PAB排除法； (ii) 提升相關投資之最低比例以符合環境／社會特徵，或將永續投資之最低比例自70%提高至80%。 相關基金將持續被視為SFDR第8條定義所指具有「促進環境及/或社會特徵」，並依適用之法令規範，適用之契約前揭露（PCDs）將自生效日起載於公開說明書附錄辛。
貝萊德營養科學基金	依ESMA新準則建議之實施，本基金之投資目標及政策已修訂，將採用CTB排除法。 本基金將持續具有SFDR第9條定義所指「永續目標」，並依適用之法令規範，適用之契約前揭露（PCD）（PCD）將自生效日起載於公開說明書附錄辛。
貝萊德智慧數據永續環球小型企業基金（即將更名為「貝萊德智慧數據環球小型企業基金」（本基金非屬環境、社會及治理相關主題基金））	本基金之投資目標及政策已修訂如下： (i) 移除本基金必須優於指數之ESG成果之承諾；以及 (ii) 取消從本基金相關指數排除至少20%之最差ESG 評分之有價證券之最低比例要求。 本基金將持續被視為SFDR第8條定義所指具有「促進環境特徵」，並依適用之法令規範，適用之契約前揭露（PCD）將自生效日起載於公開說明書附錄辛。

基金名稱之變更

根據公布之ESMA準則以及其投資政策和目標之更新，下列基金之名稱將更新如下：

- (i) 貝萊德智慧數據永續環球小型企業基金（Systematic Sustainable Global SmallCap Fund）更名為「貝萊德智慧數據環球小型企業基金（本基金非屬環境、社會及治理相關主題基金）（Systematic Global SmallCap Fund）（原名「貝萊德智慧數據永續環球小型企業基金」）」

根據公布之ESMA準則，下列基金之投資政策、目標及基金英文名稱更新（譯註：僅更新英文名稱，中文名稱不變）如下：

- (i) 「貝萊德世界債券基金（本基金非屬環境、社會及治理相關主題基金）（Sustainable World Bond Fund）」更名為「貝萊德世界債券基金（World Bond Fund）（原名「貝萊德世界債券基金(本基金非屬環境、社會及治理相關主題基金)」）」

為避免疑義，上開基金名稱都將在公開說明書中進行修改，以在相關部分反應新基金名稱。

ESG變更之費用影響

相關基金及／或其股東所負擔之費用，不會因擬進行之變更而增加。

與ESMA準則無關之公開說明書變更

除上述因施行ESMA新準則而進行之變更外，其他ESMA 準則無關所實施之變更，亦將於本函第二節闡述並通知股東。

「管理」乙節之變更

「管理」乙節將修訂如下以反映管理公司董事會之現有結構：

Tarek Mahmoud先生自2024年10月1日起辭任董事。

「重要通知」乙節之變更

修訂「重要通知」乙節，以反映在盧森堡證券金融監督委員會24/856號函令生效後，投資人透過中介機構投資貝萊德全球基金，其獲補償之權利在基金發生淨資產價值計算錯誤、未遵守投資限制規定及／或發生其他錯誤時可能會受影響。

「法國社會責任投資標籤」乙節之變更

因 (i) 貝萊德新世代運輸基金（基金之配息來源可能為本金）、(ii) 貝萊德營養科學基金及 (iii) 貝萊德永續能源基金（基金之配息來源可能為本金）將不再被授予「法國社會責任投資標籤」，「法國社會責任投資標籤」乙節將修訂移除上述基金。

由於新版的「法國社會責任投資標籤框架」（第3版）已在2025年3月1日生效實施並於2025年1月25日結束過渡期，「法國社會責任投資標籤」乙節亦為此作了進一步的修訂。此框架就涉及高強度氣候影響因素之環境及社會關鍵議題之基金設立新目標。各法人發行人將依據法國社會責任投資標籤標準附件7所列的法人及主權發行人排除法進行評價。

此社會責任投資標籤將維持其一般性質，加強對於社會、環境及治理之標準。

由於新的法國SRI標籤框架（V3）分階段生效，並確保自2025年1月1日起適用的新的規定得以被遵守，以下基金的ESG承諾將作如下修改：

貝萊德ESG社會責任多元資產基金（基金之配息來源可能為本金）將承諾減少至少最後25%評級有價證券，以獲得優於其指數之ESG成果。。

投資管理部分之變更

投資管理之章節已根據貝萊德（BlackRock）之新的議合優先事項進行更新，總結貝萊德與被投資公司進行建設性及長期之方法，並反映投資者之投資期限。相關議合優先事項包括貝萊德最常與被投資公司接觸之五個主題：董事會品質及效率、策略、目標及財務韌性、與創造金融價值一致之激勵措施、氣候級自然資本以及被投資公司對人的影響。

相關基金「投資目標及政策」乙節之變更

亞洲老虎國家清單之變更

「亞洲老虎國家」之清單定義已更新，移除柬埔寨、寮國及緬甸；及加入斯里蘭卡、日本及蒙古。為避免任何混淆，此變更僅就貝萊德亞洲老虎債券基金（基金有相當比重投資於非投資等級之高風險債券且配息來源可能為本金）之投資範圍內有影響。

費用

相關基金及／或其股東負擔之費用及支出，不會因本函所載之內容而有任何增加。相關費用及支出（例如郵寄費用）將由基金管理公司自相關基金所收取之年度服務費中支付。

您須採取之行動

股東無須針對本函所載之變更採取任何行動。然而，若您不同意本函所載之變更，您可依據公開說明書之規定，於本函寄送日後六(6)週內或變更生效日前隨時贖回您持有的股份，且無須支付任何贖回費用。

若您對贖回程序有任何疑問，請聯繫您的當地代表或貝萊德之投資者服務團隊（詳見下述）。贖回您的股份可能影響您的稅務狀況，您應諮詢您的專業顧問，以瞭解根據您的司法管轄區法律，針對處分股份可能產生的稅務影響。

如本公司已收訖申請贖回相關文件（如公開說明書所述），贖回款項將於相關交易日起之三（3）個營業日內支付予股東。

一般資訊

自生效日起，更新版之公開說明書可自本公司網站（www.blackrock.com）下載，亦可免費索取紙本版。此外，本公司章程、年報及半年報之副本亦可自本公司網站下載，如需紙本版，請聯繫您的當地代表或投資服務團隊免費索取；電子郵件信箱：Investor.services@blackrock.com，或致電：+886 2 2326 1600。

董事會對本函之內容負責。就董事會所知所信（其已採取一切合理之注意以確信係如此），本函所載資訊均本於事實，並無遺漏任何可能影響該等資訊解釋之情事。

誠摯地，



Denise Voss
貝萊德全球基金主席

(中譯文僅供參考，與原文相較不盡完整，亦有歧異，如有疑義應以英文本為準。)

基金	ISINs	ESG政策
貝萊德ESG社會責任多元資產基金（基金之配息來源可能為本金）	LU2452424414	ESG政策 基金將適用貝萊德EMEA基準篩選政策及歐盟巴黎協定指標排除標準。 投資顧問亦擬限制其投資於全球行業分類標準（GICS）內石油及氣體勘探與生產行業內之公司，及全球行業分類標準（GICS）內綜合石油和氣體行業內之公司投資限額，以基金總資產的5%為限。投資顧問亦擬限制直接投資下列各項發行人證券：酒類產品之製造、銷售或授權；擁有或經營與賭博有關的活動或設施；與核能有關之製造、供應及開採活動及成人娛樂物品之生產。評定各項活動參與程度，可基於收益百分比、特定總收益之門檻，或與受限制活動之關聯性（無論獲取收益之多寡）。投資顧問將會排除依MSCI ESG評等低於BBB之任何發行人。 接著投資顧問將對其餘篩選後之公司（即尚未被基金排除於投資範圍之公司）進行評分，該評分係依據其管理與貫徹ESG業務實務相關的風險和機會之能力，以及其ESG風險和機會層面之資歷，例如其領導階層及公司治理架構（被視為永續成長之基石），其策略性管理與ESG相關長期問題之能力以及該面向對公司財務狀況之潛在影響。 為進行此分析，投資顧問可能會使用外部ESG供應商提供之數據，專有模型和當地情報，並可進行實地考察。基金得（包括但不限於透過CIS之衍生性工具、現金、準現金工具及集合投資計劃的股份或單位以及由全球政府及機構發行的固定收益可轉讓證券（也稱為債務證券））有限度地間接投資與上述ESG標準不一致之發行人。 基金所投資之有價證券發行人，超過 90%具有 ESG 評分或已進行 ESG分析。 基金之ESG分數將按各個發行人ESG分數（以適用者為準）之總和並按其市值加權計算。投資顧問將建構一個力求ESG成果優於有關指數之投資組合，並且於指數中排除至少25%評級最低之有價證券後，基金之加權平均 ESG 評分將高於指數的 ESG 評分。投資顧問有意使本基金之碳排放強度得分低於指數。 請參閱第76頁SFDR之揭露以瞭解本基金就ESG承諾之更多資訊。 使用指標 基金屬主動式管理基金，投資顧問就基金投資之選擇有其裁量權。為此，投資顧問在建構基金投資組合及出於風險管理的目的，將參考包含綜合指數（其認為可合理代表基金的投資範圍，係由25%摩根士丹利世界指數、25%摩根士丹利世界歐元避險指數及50%彭博全球綜合債券歐元避險指數（25% MSCI World Index, 25% MSCI World Index hedged to EUR, and 50% Bloomberg Global Aggregate Bond Index hedged to EUR）所組成）（「指數」），以確保基金承擔之主動風險（即偏離指數之程度）在考量到基金之投資目標和政策之下，仍屬適當。進行投資選擇時，投資顧問不受有關指數成分或權重的約束。本基金之加權平均ESG評分將高於指數摒除至少20%最低評分之有價證券後之分數。指數之組成部分（即摩根士丹利世界指數、摩根士丹利世界歐元避險指數及彭博全球綜合債券歐元避險指數）可能在基金相關的行銷資料中分別引述。詳情請參閱指數提供者網站：www.msci.com及www.bloomberg.com/professional/product/indices。
	LU1822773989	
	LU0827879924	
	LU2776653953	
	LU0473185139	
	LU2250418576	
	LU0494093205	
	LU0093503497	
	LU2092627202	
	LU2940470938	
	LU2250418493	
貝萊德新世代運輸基金（基金之配息來源可能為本金）	LU2400292194	貝萊德新世代運輸基金（基金之配息來源可能為本金）以盡量提高總回報為目標。本基金在全球將總資產至少70%投資於主要從事研究、開發、生產及/或銷售應用於交通運輸技術的公司之股權證券。 本基金將聚焦於從轉型至較低碳交通系統過程中產生收益的公司（例如電動車、自動駕駛車輛及/或數位聯結車）。本基金總資產將依照下述ESG政策進行投資。 雖然本基金的大部分投資可能會投入於全球已開發市場的公司，但本基金亦可能投資於新興市場。 本基金為互聯互通基金，且可透過互聯互通交易機制在不超過總資產20%之範圍內直接投資於中國。 本基金投資在應急可轉換債券以其總資產的5%為限。 本基金得為投資及增進投資效益之目的使用衍生性金融商品。上述提及之任何ESG評級或分析均僅適用於本基金運用之衍生性金融商品之相關有價證券。 ESG政策 基金將適用歐盟巴黎協定指標排除標準。
	LU1861214812	
	LU1861214903	
	LU1861215389	
	LU2533727025	

基金	ISINs	
		於正常市場情況下，本基金將投資從事包含以下活動之大型、中型及小型市值公司之股權證券投資組合：原物料（例如金屬和電池材料）、零組件和電腦系統（例如電池和傳輸線）、科技（例如車輛感應技術）和基礎設施（例如車輛電池充電站）。投資顧問將對公司進行評分，係依據其管理與再生能源相關的風險和機會之能力，以及其ESG風險和機會層面之資歷，例如其領導階層及公司治理架構（被視為永續增長之基石），其策略性管理與ESG相關長期問題之能力以及該面向對公司財務狀況之潛在影響。評定各項活動參與程度，可基於收益百分比、特定總收益之門檻，或與受限制活動之關聯性（無論獲取收益之多寡）。 本基金就永續投資採用「同類別最佳」之取向，意謂本基金就每項相關活動領域（從ESG觀點）選擇最佳發行人（但不排除任何活動領域）。本基金所投資之有價證券發行人，90%以上係具有ESG評級或已經過ESG分析。 雖然本基金所投資之公司之加權平均ESG評分，在排除該指數中至少20%評級最低之有價證券後，將高於摩根士丹利所有國家世界指數。的大部分投資可能會投入於全球已開發市場的公司，但本基金亦可能投資於新興市場。本基金為互聯互通基金，且可透過互聯互通交易機制在不超過總資產20%之範圍內直接投資於中國。 本基金投資在應急可轉換債券以其總資產的6%為限。 本基金得為投資及增進投資效益之目的使用衍生性金融商品。上述提及之任何ESG評級或分析均僅適用於本基金運用之衍生性金融商品之相關。 請參閱第76頁SFDR之揭露以瞭解本基金就ESG承諾之更多資訊。 所用風險管理計量方法：承諾法。 使用指標 本基金屬主動式管理基金，投資顧問就基金投資之選擇有其裁量權且過程中不受任何指標之限制。投資顧問認為摩根士丹利所有國家世界指數（MSCI All Countries World Index）可合理地代表本基金的投資範圍，投資人應用以比較基金績效。摩根士丹利所有國家世界指數衡量已發展及新興市場國家之大型及中型股票之表現。詳情請參閱指數提供者網站：www.msci.com/acwi。 從摩根士丹利所有國家世界指數中排除至少20%評級最低之有價證券後，基金之加權平均ESG評級將高於該指數之ESG評級。
貝萊德環球動力股票基金 (本基金非屬環境、社會及治理相關主題基金)	LU0368268198 LU0238689110 LU0238689623	ESG政策 本基金將適用貝萊德EMEA篩選基準及歐盟巴黎協定指標排除標準。 投資顧問將採用專有方法，依據投資與外部效益或外部成本（即投資顧問對環境與社會之效益或成本的定義）之關聯程度評估投資。投資顧問將尋求增加對被認為具有外部效益之標的進行投資（例如低碳排放發行人或具有正面ESG資歷之發行人）；並尋求限制投資於被認為具有外部成本之標的（例如高碳排放、具有某些商業爭議行為之發行人，以及具有負面ESG資歷之發行人）。 無論獲取收益之多寡，欲評估各項活動參與程度，均得透過收益百分比、特定總收益門檻，或與受限制活動之任何關聯性評定之。 接下來，投資顧問將對經篩選後之發行人（即尚未被排除於基金投資範圍以外之發行人）進行評估，除其他因素外，該評估係依據其管理與ESG業務實務相關的風險和機會之能力，及其ESG風險與機會層面之資歷，例如其領導階層及治理架構（被視為永續成長之基石）、其策略型管理與ESG相關長期問題之能力以及該能力對於該發行人財務狀況之潛在影響。 <u>相較於指數，ESG政策使基金之投資範圍縮小至少20%。</u> <u>投資顧問擬使基金之碳排放強度得分低於該指數。</u> 基金所投資之有價證券發行人，超過90%具有ESG評分或已進行ESG分析。為進行此分析，投資顧問可能會使用外部ESG提供者、專有模型和當地情報所提供之數據，並可能進行實地考察。 本基金得有限度地間接投資於不符合前開ESG標準之發行人，投資項目包含但不限於衍生性商品及CIS之股份或單位。 欲了解本基金所為ESG相關承諾之更多詳細資訊，請參考第76頁SFDR之揭露規範。
貝萊德營養科學基金	LU0471298348 LU0629637199 LU0385154629	<u>貝萊德營養科學基金</u>以盡量提高總回報為目標，將不少於70%的總資產投資於從事任何可認為構成部分食物及農業價值鏈之活動之公司的股權證券，包括包裝、加工、運銷、科技、食物與農業相關服務、種子、農業或食品級化學品及食物生產。其中，本基金投資於在營養科學主題內積極應對全球永續發展挑戰的公司。所側重之三大永續發展之營養科學趨勢為：促進健康及永續飲食選擇，提升全球食物供應鏈之效率，以及減少資源密集型農業。投資顧問將對公司進行評分，該評分係依據其管理與營養科學主題相關之風險和機會之能力，以及其環境、社會及公司治理

基金	ISINs	
		（「ESG」）風險和機會層面之資歷，例如其領導階層及公司治理架構（被視為於永續增長之基石），其策略性管理與ESG相關長期問題之能力以及該面向對公司財務狀況之潛在影響。評定各項活動參與程度，可基於收益百分比、特定總收益之門檻，或與受限制活動之聯繫（無論獲取收益之多寡）。<u>本基金之所有資產將根據以下之ESG政策進行投資。</u> 本基金為互聯互通基金，且可透過互聯互通交易機制在不超過總資產20%之範圍內直接投資於中國。 本基金投資在應急可轉換債券以其總資產的5%為限。 本基金得為投資及增進投資效益之目的使用衍生性金融商品。上述提及之任何ESG評級或分析均僅適用於本基金運用之衍生性金融商品之相關有價證券。 ESG政策 <u>本基金將適用歐盟氣候轉型指標排除標準。</u> 本基金就永續投資採用「同類別較佳」之取向，意謂基金就每項相關活動領域（從ESG觀點）選擇最佳發行人（但不排除任何活動領域）。本基金所投資之有價證券發行人，90%以上係具有ESG評級或已經過ESG分析。 依據投資顧問之意見，本基金之投資範圍遍及全球任何公司其優先考量改變消費者對於營養之取向，作為其業務之主要策略（「Factset營養科學範圍」）。從Factset營養科學範圍排除至少20%評級最低之有價證券後，基金的加權平均ESG評級將高於Factset營養科學範圍的ESG評級。 請參閱第76頁SFDR之揭露以瞭解本基金就ESG承諾之更多資訊。 所用風險管理計量方法：承諾法。
貝萊德永續能源基金（基金之配息來源可能為本金）	LU0147411861 LU2471418470 LU2533724782 LU0124384867 LU0534476519 LU0252969661 LU0171289902	<u>貝萊德永續能源基金（基金之配息來源可能為本金）</u>以盡量提高總回報為目標。本基金在全球將總資產至少70%投資於新能源公司的股權證券。永續能源公司指從事替代能源與能源科技的公可，包括再生能源科技、再生能源發展商、可替代燃料、能源效率、啟動能源與基礎建設。投資顧問將對公司進行評分，係依據其管理與替代能源及能源科技相關的風險和機會之能力，以及其ESG風險和機會層面之資歷，例如其領導階層及公司治理架構（被視為於永續增長之基石），其策略性管理與ESG相關長期問題之能力以及該面向對公司財務狀況之潛在影響。 <u>本基金之所有資產將根據以下之ESG政策進行投資。</u> 本基金為互聯互通基金，且可透過互聯互通交易機制在不超過總資產20%之範圍內直接投資於中國。 本基金投資在應急可轉換債券以其總資產的5%為限。 本基金得為投資及增進投資效益之目的使用衍生性金融商品。上述提及之任何ESG評級或分析均僅適用於本基金運用之衍生性金融商品之相關有價證券。 ESG政策 <u>本基金將適用歐盟巴黎協定指標排除標準。</u> 本基金將不投資於從事以下活動之公司（按全球產業分類標準定義中的產業）：煤炭與消耗性能源、石油天然氣探勘及生產、綜合石油天然氣。評定各項活動參與程度，可基於收益百分比、特定總收益之門檻，或與受限制活動之關聯性（無論獲取收益之多寡） 本基金就永續投資採用「同類別較佳」之取向，意謂本基金就每項相關活動領域（從ESG觀點）選擇最佳發行人。本基金所投資之有價證券發行人，90%以上係具有ESG評級或已經過ESG分析。 從摩根士丹利所有國家世界指數（MSCI All Countries World Index）排除至少20%評級最低之有價證券後，本基金的加權平均ESG評級將高於摩根士丹利所有國家世界指數（MSCI All Countries World Index）的ESG評級。 請參閱第76頁SFDR之揭露以瞭解本基金就ESG承諾之更多資訊。 所用風險管理計量方法：承諾法。
貝萊德世界債券基金（原英文名稱為「Sustainable World Bond Fund」）	LU0184696937 LU0184696853 LU0297941972 LU0330917880	<u>貝萊德世界債券基金（原英文名稱為「Sustainable World Bond Fund」）</u>以盡量提高總回報為目標，並以貫徹環境、社會及公司治理（即「ESG」）投資原則的方式進行投資。本基金將總資產不少於70%投資於投資級固定收益可轉讓證券。貨幣風險將靈活管理。 本基金為中國銀行間債券市場基金，可以在不超過總資產20%之範圍內透過境外投資計劃及／或債券通及／或相關法規可能不時允許的其他方式，直接投資於在中國銷售的中國銀行間債券市場的在岸債券。

基金	ISINs	
	LU1087925589	本基金尋求投資於永續投資，包括但不限於「綠色債券」（按國際資本市場協會綠色債券原則指引下的專有方法定義）且其總資產將根據下述的ESG政策進行投資。 作為其投資目標的一部分，本基金最多可投資其總資產的50%於資產抵押證券（ABS）及房貸抵押證券（MBS）無論是否為投資等級。其中可包括資產抵押商業票據、擔保抵押債務、擔保房貸債務、商業房貸抵押證券、信貸連結票據、房地產抵押投資管道、住宅抵押證券以及合成抵押債務。資產抵押證券與房貸抵押證券之資產標的可能包括貸款、租約或應收帳款（例如資產抵押證券之信用卡債務、汽車貸款、學生貸款，與房貸抵押證券中來自於被規管與經授權之金融機構之商業與住宅房貸）。本基金所投資之資產抵押證券與房貸抵押證券可能使用槓桿以提高對股東之報酬。在不採取直接投資於該證券之方式而可取得對不同發行者證券績效之曝險，特定資產抵押證券可能架構於使用衍生性金融商品，如信用違約交換或一籃子此等衍生性金融商品之上。 本基金在應急可轉換債券的投資以基金總資產的20%為限。本基金投資在艱困證券以其總資產的10%為限。 本基金得為投資及增進投資效益之目的使用衍生性金融商品。 本基金可大量投資於資產抵押證券、房貸抵押證券及非投資等級債務，謹敦請投資人閱讀「特殊風險考慮因素」一節所載的相關風險揭露資料。 所用風險管理計量方法：相對風險值，以彭博環球綜合美元避險指數作為適當指標。 基金的預計槓桿比率：資產淨值的350%。
貝萊德智慧數據環球小型企業基金（本基金非屬環境、社會及治理相關主題基金）（原名稱為「貝萊德智慧數據永續環球小型企業基金」）	LU0054578231 LU0724617971 LU0171288334 LU1023057448	<u>貝萊德智慧數據永續環球小型企業基金（本基金非屬環境、社會及治理相關主題基金）（原名稱為「貝萊德智慧數據永續環球小型企業基金」）</u>以盡量提高總回報為目標。本基金將總資產至少70%以貫徹永續投資原則的方式投資於全球各地較小市值公司的股權證券。較小市值公司指於購入時，其市值為全球股票市場中較小之20%的公司。雖然本基金的大部分投資會集中於位於全球已開發市場的公司，但仍可投資於全球的新興市場。貨幣風險將靈活管理。 為實現其投資目標和政策，本基金將投資於各種投資策略及工具。尤其是本基金將使用量化（即數學或統計）模型，以達到系統性（即基於規則）選擇股票之方式。這意味著，在考慮風險和交易成本預測時，將根據股票對投資組合回報的預期貢獻來進行選擇。 ESG政策 本基金將適用貝萊德 EMEA 基準篩選政策並尋求投資於永續投資。本基金為互聯互通基金，且可透過互聯互通交易機制在不超過總資產20%之範圍內直接投資於中國。 基金之ESG分數將按各個發行人ESG分數（以適用者為準）之總和並按其市值加權計算。 投資顧問將建構一個力求ESG成果優於有關指數之投資組合，並且在從有關指數剔除至少 20% 評分最低之有價證券後，本基金之加權平均 ESG 評分將高於指數的 ESG 評分。投資顧問有意基金之碳排放強度得分低於其指數。 本基金得為投資及增進投資效益之目的使用衍生性金融商品。 所用風險管理計量方法：承諾法。
貝萊德美國政府房貸債券基金	LU0172418690 LU0424777026 LU0096258446 LU1456639035	<u>貝萊德美國政府房貸債券基金</u>以爭取高收入為目標。本基金將總資產至少80%投資於美國政府所發行或擔保具有正向社會及／或環境影響力之固定收益可轉讓證券。 本基金可投資於美國政府、政府部門或機構所發行或擔保的固定收益可轉讓證券，包括美國政府國家抵押貸款協會（Government National Mortgage Association, 「GNMA」）的房貸抵押型證券，以及其他代表房貸抵押型資金權益的美國政府證券，例如由房利美（Fannie Mae）及房地美（Freddie Mac）所發行的房貸抵押型證券，其具有投資顧問酌情認為有社會及／或環境影響特性，且投資顧問酌情認為具有影響力之房貸抵押型證券，包括（但不限於）農村住房、製造業住房、由州政府住房金融局（State Housing Finance Authorities）發行之住房資產池。本基金所投資的所有證券均為美元計價之證券。 「影響」投資旨在產生正向、可衡量的社會及／或環境影響以及財務報酬之投資。本基金之投資決策將基於機構及計畫之具體研究，以識別及選擇上述投資顧問認為具有可能產生有吸引力之收益報酬，且同時具有對社會及／或環境產生正向社會影響之固定收益證券。該團隊評估現有的住房計畫和提案，以確定社會及／或環境影響的程度，以及這些計畫或提案如何促進增加住房所有權、借款人儲蓄、支持增加可負擔住房之供給及／或降低可負擔住房之信用貸款障礙。為進行此等分析，投資顧問可能會使用外部ESG提供者所提供之數據、專有模型和當地情報，並可進行實地訪查。本基金所投資之有價證券發行人，90%以上係具有ESG評級或已經過ESG分析。本基金將適用貝萊德EMEA基準篩選政策。 本基金最多可投資其總資產的100%於資產抵押證券（ABS）及房貸抵押證券（MBS）無論是否為投資等級。資產抵押證券及房貸抵押證券一般在美國發行，證券化資產將獲至少一間具領導地位的信用評等機構評定為投資等級，擔保資產抵押證券及房貸抵押證券（agency ABS/MBS）將與美國政府具有同等信用評等。其中可包括資產抵押商業票據、擔保抵押債務、擔保房貸債務、商

基金	ISINs	
		業房貸抵押證券、信貸連結票據、房地產抵押投資管道、住宅抵押證券以及合成抵押債務。資產抵押證券與房貸抵押證券之資產標的可能包括貸款、租約或應收帳款（例如資產抵押證券之信用卡債務、汽車貸款、學生貸款，與房貸抵押證券中來自於被規管與經授權之金融機構之商業與住宅房貸）。本基金所投資之資產抵押證券與房貸抵押證券可能使用槓桿以提高對股東之報酬。特定資產抵押證券（ABS）可能建構於使用衍生性金融商品（如信用違約交換或一籃子此等衍生性金融商品）之上，以取得對不同發行者證券績效之曝顯，而毋須直接投資於該證券。<u>本基金之所有資產將根據以下之ESG政策進行投資。</u> 本基金得為投資及增進投資效益之目的使用衍生性金融商品。 ESG政策 本基金將適用貝萊德EMEA基準篩選政策及歐盟巴黎協定指標排除標準。 本基金所投資之有價證券發行人，90%以上係具有ESG評級或已經過ESG分析。 請參閱第76頁SFDR之揭露以瞭解本基金就ESG承諾之更多資訊。 本基金可大量投資於資產抵押證券、房貸抵押證券及非投資等級債務，鼓勵投資者閱讀「特殊風險考慮因素」一節所載的相關風險揭露資料。 所用風險管理計量方法：相對風險值，以彭博不動產抵押貸款證券美國(MBS)指數作為適當指標。 基金的預計槓桿比率：資產淨值的240%。