

法銀巴黎證券投資顧問股份有限公司 函

地址：110 台北市信義路五段 7 號 71 樓之 1

電話：(02)7718-8188

受文者：如行文單位

發文日期：中華民國 109 年 05 月 11 日

發文字號：法巴顧字第 1090049 號

速別：

密等及解密條件或保密期限：普通

附件：投資人通知中英文版

主旨：謹通知法銀巴黎證券投資顧問股份有限公司所代理法巴基金(BNP Paribas Funds) 及法巴 A 基金(BNP PARIBAS A Fund)之波幅定價及短線交易相關事項，詳如說明，請查照。

說明：

一. 波幅定價因素之最大限制暫時提高:

在目前新冠肺炎特殊的市場情形下，以及特殊的市場流動性狀況，公開說明書所述之最高 1%波幅定價費用及佣金(波幅定價因素)，可能不足以因應負面之稀釋影響。

因此，為了投資人之最佳利益以及公平投資對待，對於特定子基金之波幅定價因素可能暫時性被提高至超過目前最大限制。適用之波幅定價因素水準將與所涉及之市場流動性成本一致。請參閱附件投資人通知。

受影響之子基金如下

法巴新興市場債券基金
法巴新興市場精選債券基金
法巴歐洲可換股債券基金
法巴全球高收益債券基金
法巴新興市場當地貨幣債券基金
法巴美國高收益債券基金

二. 短線交易通知事項:

法銀巴黎投顧所代理之境外基金，其短線交易規定如下

法巴基金(BNP Paribas Funds)及法巴 A 基金(BNP Paribas A Fund)施行短線交易(積極交易)監控所定義之短線天數為七(7)天。除天數之外，請注意以下之事項：

基金的投資只以長線投資為目標。董事會將採取合理的措施，致力預防過份頻密、擇時交易及／或短線交易(積極交易)或類似濫用行為。若董事會相信由任何一名或多名投資者作出的任何贖回、認購或轉換要求將擾亂或損害基金組合和帳戶的交易活動，董事會保留權利在毋須預先通知的情況下，以任何理由拒絕該贖回、認購或轉換要求，及在適用的情況下採取所需措施，以保障本公司的其他投資人，特別是透過收取最多 2%的額外贖回費，該費用將由子基金保留。

正本：永豐商業銀行股份有限公司(理財商品部)、台灣中小企業銀行、花旗(台灣)商業銀行、彰化商業銀行、兆豐國際商業銀行、華泰商業銀行、台北富邦商業銀行股份有限公司、華南商業銀行股份有限公司、渣打國際商業銀行股份有限公司、玉山商業銀行股份有限公司、日盛國際商業銀行股份有限公司、凱基銀行、陽信商業銀行、台新國際商業銀行、星展(台灣)商業銀行股份有限公司、中國信託商業銀行、第一商業銀行股份有限公司、遠東國際商業銀行、台灣土地銀行、合作金庫商業銀行股份有限公司、聯邦商業銀行股份有限公司、安泰商業銀行股份有限公司、國泰世華商業銀行股份有限公司、元大商業銀行股份有限公司、台灣新光商業銀行股份有限公司、京城商業銀行股份有限公司、台中商業銀行股份有限公司、群益金鼎證券股份有限公司、上海商業儲蓄銀行、三信商業銀行股份有限公司、法商法國巴黎銀行台北分行、復華證券投資信託股份有限公司、國泰證券投資信託股份有限公司、群益證券投資信託股份有限公司、富邦綜合證券股份有限公司、永豐金證券股份有限公司、萬寶證券投資顧問股份有限公司、先鋒證券投資顧問股份有限公司、安聯人壽保險股份有限公司、高雄銀行股份有限公司、台灣人壽保險股份有限公司、統一證券股份有限公司、凱基證券股份有限公司、日盛證券股份有限公司、元富證券股份有限公司、國票綜合證券股份有限公司、元大證券股份有限公司、第一金人壽保險股份有限公司、康和證券股份有限公司、法商法國巴黎人壽保險股份有限公司台灣分公司、富邦人壽保險股份有限公司、柏瑞證券投資信託股份有限公司、臺灣銀行、板信商業銀行、匯豐(台灣)商業銀行股份有限公司、合庫人壽保險股份有限公司、兆豐證券股份有限公司、全球人壽保險股份有限公司、兆豐證券投資信託股份有限公司、合作金庫證券投資信託股份有限公司、合作金庫人壽保險股份有限公司、元大證券投資信託股份有限公司、英屬百慕達商安達人壽保險股份有限公司台灣分公司、德盛安聯證券投資信託股份有限公司、鉅亨證券投資顧問股份有限公司、核聚證券投資顧問股份有限公司、中國信託證券投資信託股份有限公司、富盛證券投資顧問股份有限公司、基富通證券股份有限公司、富達證券投資信託股份有限公司、台新證券投資信託股份有限公司、保德信證券投資信託股份有限公司、國泰綜合證券股份有限公司

總經理 陳能耀

BNP Paribas Funds

Luxembourg SICAV – UCITS category

Registered office: 10 rue Edward Steichen, L-2540 Luxembourg

Luxembourg Trade and Companies Register n° B 33363

Notice to shareholders

Luxembourg, May 12, 2020

Dear Shareholders,

As described in the Prospectus, the Board of Directors of the Company may decide to apply the **Swing Pricing mechanism** to protect remaining shareholders in a sub-fund against the negative dilution impact due to the volume of purchase and sale transactions in a given sub-fund and the size of these transactions.

Given the current exceptional market circumstances involved by the COVID-19, and exceptional liquidity conditions observed on the markets, the maximum Swing Pricing fees and commissions of 1% (the "**swing factor**") disclosed in the Prospectus may not be sufficient to adequately cover the negative dilution impact.

Therefore, in your best interests and fair treatment, the swing factor applicable to certain sub-funds may be temporarily raised beyond the current maximum limit.

The applied swing factor level will be consistent with the liquidity costs observed on the invested markets.

This measure might apply with immediate effect to the following sub-funds:

Emerging Bond
Emerging Bond Opportunities
Euro High Yield Bond
Euro High Yield Short Duration Bond
Euro Short Term Corporate Bond Opportunities
Europe Convertible
Europe Small Cap Convertible
Global Convertible
Global High Yield Bond
Local Emerging Bond
US High Yield Bond

Information regarding the swing pricing mechanism, the methodology by asset classes, and its implementation status are available upon request.

ADDITIONAL INFORMATION

Additional clerical changes have been made to update and enhance the general wording of the Prospectus or to comply with new laws and regulations.



BNP PARIBAS
ASSET MANAGEMENT

The asset manager
for a changing
world

Terms or expression not defined in the present notice have the same meaning as in the Prospectus of the Company.

If your shares are held by a clearing-house, we advise you to enquire about the specific terms applying to subscriptions, redemptions and conversions made via this type of intermediary.

Please note that except for the newspaper publications required by Law, the official media going forward to obtain any notice to shareholders will be our website www.bnpparibas-am.com.

QUESTIONS?

In case of any question, please contact our Client Service (+ 352 26 46 31 21 /AMLU.ClientService@bnpparibas.com).

Best regards,

The Board of Directors

法巴基金 BNP Paribas Funds

簡譯中文

Luxembourg SICAV – UCITS category
Registered office: 10 rue Edward Steichen, L-2540 Luxembourg
Luxembourg Trade and Companies Register n° B 33363

投資人通知

盧森堡, 2020 年 5 月 12 日

致投資人,

如同公開說明書所述, 董事會得決定啟動**波幅定價機制**, 以保護持續持有子基金之投資人, 有關其所受到對子基金申購與贖回之交易及其規模, 所造成的負面稀釋影響。

在目前新冠肺炎特殊的市場情形下, 以及特殊的市場流動性狀況下, 公開說明書所述之最高 1%波幅定價費用及備金(波幅定價因素), 可能不足以因應負面之稀釋影響。

因此, 為了您之最佳利益以及公平投資對待, 對於特定子基金之波幅定價因素可能暫時性被提高至超過目前最大限制。適用之波幅定價因素水準將與所涉及之市場流動性成本一致。

此方式對以下子基金可能有立即適用效果:

新興市場債券基金
新興市場精選債券基金
歐洲可換股債券基金
全球高收益債券基金
新興市場當地貨幣債券基金
美國高收益債券基金

有關波幅定價機制、不同資產類別之方法及其適用狀況之資訊, 可要求獲取。

其他資訊

增加文字, 用以更新及增加公開說明書整體文字的完整性, 以符合新的法規。

未於此投資人通知所定義之辭彙或表達, 與公開說明書中之辭彙或表達具有相同之意義。

若您的股份由清算機構所持有, 我們建議您獲取經由此類中間機構確認之申購、贖回及轉換之方式。

請注意除了於法規所要求之報章公告外, 可以獲取後續任何投資人通知的媒體, 為法國巴黎資產管理的網站 www.bnpparibas-am.com。

疑問?

若您有任何疑問, 請聯繫我們的客戶服務部門 (+ 352 26 46 31 21 / AMLU.ClientService@bnpparibas.com)。

董事會



BNP PARIBAS
ASSET MANAGEMENT

The asset manager
for a changing
world