

# 瀚亞證券投資信託股份有限公司

## 公 告

中華民國 106 年 10 月 25 日 (106) 瀚亞字第 0524 號

主旨：本公司經理之「瀚亞趨勢精選組合證券投資信託基金」(以下簡稱瀚亞趨勢精選組合基金)與「瀚亞股債入息組合證券投資信託基金」(以下簡稱瀚亞股債入息組合基金)合併事宜公告。

公告事項：

一、金管會核准函日期及文號：金融監督管理委員會中華民國(以下同)106年10月19日金管證投字第1060039693號核准函。

二、存續基金之名稱、基金經理人、投資策略：

(一)存續基金之名稱：瀚亞股債入息組合基金。

(二)基金經理人：林如惠。

(三)投資策略：

(1) 基金首先擬定「戰略性資產配置」(SAA)，依照總體經濟、金融市場現況和長期發展趨勢，決定長期的股債資產配置，投資在股票型基金、債券型基金、貨幣型基金及各類型ETF等。

(2) 基金短期輔以「戰術性資產配置」(TAA)，依據評價指標、市場動能、總體經濟面變化及各區域或國家因遭遇非系統性因素所造成的股債市短期波動劇烈等之分析，並以「戰略性資產配置」(SAA)決定之股債資產配置進行調整，配置於最具投資效益的資產以達到增加收益之效果。

(3) 藉由質化與量化分析可投資基金之報酬與風險特性，再依據法規與考量公司內部風險管理制度等綜合評估後決定投資標的。

三、消滅基金之名稱：瀚亞趨勢精選組合基金。

四、合併目的及預期效益：

(一)合併目的：

1. 「瀚亞趨勢精選組合基金」為跨國投資組合型基金，投資區域為全球。基金投資目標為分散風險、確保基金之安全，並積極追求長期之投資利得及維持收益之安定；並以誠信原則及專業經營方式，將本基金投資於子基金。基金投資於子基金之總金額應達本基金淨資產價值之百分之七十；所謂子基金係指國內證券投資信託事業在國內募集發行之證券投資信託基金(即本國子基金)、經金管會依境外基金管理辦法得於中華民國境內募集及銷售之外國基金管理機構所發行或經理之受益憑證、基金股份或投資單位(即境外基金)及外國指數股票型基金(ETF)，惟不得

投資於組合型基金。本基金至少應投資於五個以上子基金，且每個子基金最高投資上限不得超過本基金淨資產價值之百分之三十。由於該基金之基金規模快速減少，恐有面臨清算之可能，為免基金清算造成投資人必須被迫取回投資，在顧及投資人權益的考量下，基金合併應是保障投資人權益最有效的方法。

2. 「瀚亞股債入息組合基金」為跨國投資組合型基金，投資區域為全球。基金投資目標為散風險、確保基金之安全，並積極追求長期之投資利得及維持收益之安定；並以誠信原則及專業經營方式，將本基金投資於子基金。基金投資於子基金之總金額應達本基金淨資產價值之百分之七十；所謂子基金係指國內證券投資信託事業在國內募集發行之證券投資信託基金(即本國子基金)、經金管會依境外基金管理辦法核准得於中華民國境內募集及銷售之外國基金管理機構所發行或經理之受益憑證、基金股份或投資單位(即境外基金)及外國指數股票型基金(ETF)，惟不得投資於組合基金。本基金至少應投資於五個以上子基金，且每個子基金最高投資上限不得超過本基金淨資產價值之百分之三十。
3. 瀚亞趨勢精選基金與瀚亞股債入息基金均屬跨國投資組合型基金，投資區域皆為全球，投資目標亦均為分散風險、確保基金之安全，並積極追求長期之投資利得及維持收益之安定，加上目前基金操作管理團隊均為瀚亞投信-環球資產配置暨固定收益部。預期基金合併將更進一步發揮其單位成本之效益及經濟規模，提升投資效益，同時加強存續基金之定位，進而可創造更優異的長期績效。

## (二)預期效益：

1. 截至 106 年 9 月底，瀚亞趨勢精選基金之基金規模共計新台幣 310,688,560 元，而瀚亞股債入息基金之基金規模為新台幣 1,978,170,952 元，兩檔基金合併後，存續基金之規模預計將可達新台幣 22.89 億；基金規模擴大後，可使其投資範圍更為廣泛且靈活，流動性也更佳，不僅有助於進一步分散基金資產的風險，也有利於基金資產因應市場變化，增加對市場的風險承受力，使基金之操作更具競爭力。
2. 增進管理績效：瀚亞趨勢精選基金與瀚亞股債入息基金同為跨國投資組合型基金，且投資區域涵跨全球；考量相關人力及資訊之重疊性高，此兩檔基金予以合併，可共享研究成果，以達相乘倍數之功效，符合合併之意旨。此兩檔基金合併後，將以維持必要之人力為準則，調整基金合併後之後勤人員工作分配，並盡可能將資源充實於各研究單位，以提升合併後基金之研究投資能力；有鑒於人力精省，投資研究部門更能將心力投入於單一基金，操作更為集中，預計對於基金之投資效能將能有效提升。
3. 降低營運成本：由於兩檔基金均有各別之人事、組織及其他基本費用成本，其統合費用相對基金規模之比重偏高，損及受益人之權益；如能將兩檔基金加以結合，

將可避免重複之支出，除此之外，資訊、研究成果、投資經驗等多項人力與物力資源可以共享，對於提昇基金之競爭力，及增加受益人之獲利，均具有正面之意義。

(三)對投資人的影響：

合併之後，瀚亞趨勢精選基金之投資人若未於本公司指定之日期前申請贖回，其所持有之瀚亞趨勢精選基金受益權單位將會依換發比例換算為瀚亞股債入息基金受益權單位，投資人權益不會受影響。另依信託契約之規定，瀚亞股債入息基金投資於境外基金及外國指數股票型基金(ETF)之總金額，每季平均不得低於本基金淨資產價值之百分之三十五(含本數)；投資於股票性質子基金之總金額，每季平均不得低於本基金淨資產價值之百分之十(含本數)，亦不得高於本基金淨資產價值之百分之七十(含本數)，故基金經理人將於合併後適時調整其佈局比重。瀚亞股債入息基金之二年/三年夏普值分別為 1.33%及 0.41%，波動度分別為 3.93%及 4.37%；瀚亞趨勢精選基金之二年/三年報酬率分別為 1.14%及 0.35%，波動度分別為 7.95%及 8.42%(截至 9/30)。預期調整後的資產配置，將能為瀚亞趨勢精選基金投資人帶來更多的正面效益。

五、合併基準日：107 年 2 月 2 日 (星期五)

六、消滅基金換發存續基金受益權單位數之計算公式：

消滅基金之受益人原持有之受益權單位數可換發存續基金之受益權單位數=

$$\text{原消滅基金受益人持有消滅基金受益權單位數} \times \left[ \frac{\text{消滅基金合併基準日單位淨值}}{\text{存續基金合併基準日單位淨值}} \right]$$

七、不同意基金合併之受益人得於公告日(106 年 10 月 25 日)後至合併基準日前二日(107 年 1 月 31 日)止之營業日，向經理公司提出買回受益憑證申請。

八、本公司自合併基準日前一日(107 年 2 月 1 日)起至瀚亞趨勢精選組合基金資產全部移轉至瀚亞股債入息組合基金之日止，停止瀚亞趨勢精選組合基金受益憑證之申購及買回。

九、定時(不)定額客戶請注意：原定時定額投資瀚亞趨勢精選組合基金之受益人，若無意轉扣款瀚亞股債入息組合基金，請於 107 年 1 月 16 日前向本公司提出終止扣款之申請，未提出申請者，將於合併基準日後自動轉扣款瀚亞股債入息組合基金。原定時不定額投資瀚亞趨勢精選組合基金之受益人，將自 107 年 1 月 27 日起終止扣款。

十、換發新受益憑證之期間、方式及地點

二檔基金之受益憑證均採無實體發行，不印製實體受益憑證。本公司將依據「受益憑證事務處理規則」及有價證券集中保管帳簿劃撥作業辦法及證券集中保管事業之相關規定辦理後續受益憑證劃撥轉換事宜。

十一、二檔基金合併，受益人如需瀚亞股債入息組合基金(存續基金)公開說明書，可逕至公開資訊觀測站 (<http://newmops.tse.com.tw>) 及本公司網站 (<http://www.eastspring.com.tw>)查詢。

十二、存續基金與消滅基金之差異摘要如下：

名稱	瀚亞股債入息組合基金 (存續基金)	瀚亞趨勢精選組合基金 (消滅基金)
投資方針及範圍	<p>經理公司應以分散風險、確保基金之安全，並積極追求長期之投資利得及維持收益之安定為目標。以誠信原則及專業經營方式，將本基金投資於國內證券投資信託事業在國內募集發行之證券投資信託基金(即本國子基金)、經金管會依境外基金管理辦法核准得於中華民國境內募集及銷售之外國基金管理機構所發行或經理之受益憑證、基金股份或投資單位(即境外基金)及外國指數股票型基金(ETF)，惟不得投資於組合基金。</p> <p>本基金至少應投資於五個以上子基金，且每個子基金最高投資上限不得超過本基金淨資產價值之百分之三十。並依下列規定投資：</p> <ol style="list-style-type: none"><li>1. 本基金自成立日起四個月後，投資於子基金之總金額應達本基金淨資產價值之百分之七十；投資於境外基金及外國指數股票型基金(ETF)之總金額，每季平均不得低於本基金淨資產價值之百分之三十五(含本數)，亦不得高於本基金淨資產價值之百分之九十五(含本數)；投資於股票型子基金之總金額，每季平均不得低於本基金淨資產價值之百分之十(含本數)，亦不得高於本基金淨資產價值之百分之七十(含本數)。</li><li>2. 但依經理公司之專業判斷，在特殊情形下，為分散風險、確保基金安全之目的，得不受前述比例之限制。所謂特殊情形，係指本基金終止前一個月。</li><li>3. 前述有關每季平均佔本基金淨資產價值之上限或下限，係指本基金於每年度三、六、九、十二月終了之日，依該季每一營業日持有該等子基金</li></ol>	<p>經理公司應以分散風險、確保基金之安全，並積極追求長期之投資利得及維持收益之安定為目標。以誠信原則及專業經營方式，將本基金投資於國內證券投資信託事業在國內募集發行之證券投資信託基金(即本國子基金)、經金管會依境外基金管理辦法得於中華民國境內募集及銷售之外國基金管理機構所發行或經理之受益憑證、基金股份或投資單位及外國指數股票型基金(ETF；指外國證券集中交易市場及美國店頭市場(NASDAQ)、英國另類投資市場(AIM)、日本店頭市場(JASDAQ)及韓國店頭市場(KOSDAQ)交易之指數股票型基金)，惟不得投資於組合型基金，並依下列規範進行投資：</p> <ol style="list-style-type: none"><li>(1)至少應投資於五個以上子基金，且每個子基金最高投資上限不得超過基金淨資產價值之百分之三十。</li><li>(2)自成立日起屆滿三個月後，投資於子基金之總金額應達基金淨資產價值之百分之七十(含本數)；投資於境外基金及外國指數股票型基金(ETF)之總金額，每季平均不得低於基金淨資產價值之百分之五十(含本數)，亦不得高於基金淨資產價值之百分之九十五(含本數)；且投資於股票型子基金之總金額，每季平均不得低於基金淨資產價值之百分之六十(含本數)。</li><li>(3)但依經理公司之專業判斷，在特殊情形下，為分散風險、確保基金安全之目的，得不受前述比例之限制。所謂特殊情形，係指基金終止前一個月。</li></ol>

	<p>之總額佔本基金淨資產價值之比例總數，除以該季之營業總計算日所得平均比例，不得超過前述之上限，亦不得低於前述之下限。</p> <p>4. 經理公司得以現金、存放於金融機構、買入短期票券方式或其他經金管會規定之方式保持本基金之資產，以前述方式保持之資產比率得為零。</p>	<p>(4) 前述有關每季平均佔基金淨資產價值之上限或下限，係指基金於每年度三、六、九、十二月終了之日，依該季每一營業日持有該等子基金之總金額佔基金淨資產價值之比例總數，除以該季之營業總計算日所得平均比例，不得超過前述之上限，亦不得低於前述之下限。</p>
新臺幣計價受益權單位收益分配之規定	<p>本基金B類型新臺幣計價類別受益權單位投資中華民國以外所得之現金股利、利息收入、子基金之收益為B類型新臺幣計價受益權單位之可分配收益。若處分投資之已實現資本利得扣除資本損失（包括已實現及未實現之資本損失）後之餘額為正數時，亦可併入B類型新臺幣計價受益權單位之可分配收益。經理公司得依前述可分配收益之情況，決定應分配之金額，依規定之時間，按月進行收益分配。惟當月可分配收益之剩餘未分配部分，亦可併入次月可分配收益。</p>	<p>瀚亞趨勢精選組合基金之收益全部併入該基金之資產，不予分配。</p>
經理費	每年 1%	每年 1%
保管費	每年 0.13%	每年 0.13%