

## 兆豐國際證券投資信託股份有限公司公告

中華民國 106 年 8 月 17 日

兆信字第 1060000352 號

主旨：本公司經理之「兆豐國際新興市場高收益債券證券投資信託基金」（以下簡稱兆豐國際新興市場高收益債券基金）及「兆豐國際大中華平衡證券投資信託基金」（以下簡稱兆豐國際大中華平衡基金）修訂證券投資信託契約部分條文及公開說明書，謹此公告。

說明：

- 一、依金融監督管理委員會中華民國 106 年 8 月 15 日金管證投字第 1060030388 號函辦理。
- 二、本公司經理之「兆豐國際新興市場高收益債券基金」及「兆豐國際大中華平衡基金」，修訂基金信託契約第二十條部份條文內容，經金融監督管理委員會核准，特此公告，自公告之翌日起生效。
- 三、本公告同時登載於中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會 (<http://www.sitca.org.tw>) 及本公司網站 (<http://www.megafunds.com.tw>)。
- 四、二檔基金信託契約修訂前後對照表如下：

兆豐國際新興市場高收益債券基金證券投資信託契約修正條文對照表

條 項	原條文	條 項	修正後條文	修訂說明
第二十條	本基金淨資產價值之計算	第二十條	本基金淨資產價值之計算	
第三項 第二款	(二)國外之資產： 1. 國外債券：以計算日臺北時間上午十一時前依序由彭博資訊(Bloomberg)、國外投資顧問公司所提供之第三方機構(其報價來源為 FT-IDC 或 Statpro 或 Bloomberg 或 MarkIt 等)、國外受託保管機構所依序提供之最近收盤價格、成交價、買價或中價加計至計算日前一營業日止應收之利息為準。持有暫停交易或久無報價與成交資訊者，依序以經理公司評價委員會或洽商其他獨立專業機構提供之公平價格為準。 2. 國內、外證券相關商品： (1)證券交易市場交易者，以計	第三項 第二款	(二)國外之資產： 1. 國外債券：以計算日臺北時間上午十一時前依序由彭博資訊 (Bloomberg)、路透社 (Reuters)、國外投資顧問公司所提供之第三方機構最近價格、成交價、買價或中價加計至計算日前一營業日止應收之利息為準。持有暫停交易或久無報價與成交資訊者，依序以經理公司評價委員會或洽商其他獨立專業機構提供之公平價格為準。 2. 國內、外證券相關商品： (1)證券交易市場交易者，以計	1. 配合經理公司旗下經理基金之一致性，增訂路透社所提供之價格資訊為國外債券淨資產價值取價來源之一。 2. 增訂彭博資訊與路透社所提供之價格資訊為於國外證券交易市場交易之證券相關商品之淨資產價值取價來源。 3. 參酌「證券投



條 項	原條文	條 項	修正後條文	修訂說明
	<p>算日經理公司於臺北時間上午十一點前取得投資所在國或地區證券交易所之最近收盤價格為準；非證券交易市場交易者，依序以計算日台北時間上午十一點前自 Bloomberg(彭博資訊)所取得之最近價格或交易對手所提供之最近價格為準；</p> <p>(2)期貨：依期貨契約所定之標的種類所屬之期貨交易市場於計算日之結算價格為準，以計算契約利得或損失。</p>		<p>算日經理公司於臺北時間上午十一點前<u>依序由彭博資訊(Bloomberg)、路透社(Reuters)</u>取得投資所在國或地區證券交易所之最近收盤價格為準；非證券交易市場交易者，依序以計算日台北時間上午十一點前自 Bloomberg(彭博資訊)所取得之最近價格或交易對手所提供之最近價格為準；</p> <p>(2)期貨：依期貨契約所定之標的種類所屬之期貨交易市場於計算日之結算價格為準，以計算契約利得或損失。</p> <p>(3)遠期外匯合約：以計算日外匯市場之結算匯率為準，惟計算日當日外匯市場無相當於合約剩餘期間之遠期匯率時，得以<u>線性差補方式計算之。</u></p>	資信託基金資產價值之計算標準」第5條第3項規定，增加遠期外匯之淨資產計算方式。

## 兆豐國際大中華平衡基金證券投資信託契約修正條文對照表

條 項	原條文	條 項	修正後條文	修訂說明
第二十條	本基金淨資產價值之計算	第二十條	本基金淨資產價值之計算	
第三項第二款	<p>(二)國外之資產：</p> <p>2、債券：大陸地區交易之債券以計算日經理公司於台北時間上午十二點前依序由萬得資訊(Wind)、彭博資訊(Bloomberg)、路透社(Reuters)所提供之最近價格、成交價、買價或中價加計至計算日前一營業日止應收之利息為準；非大陸地區交易之債券以計算日經理公司於台北時間上午十二點前依序由彭博資訊(Bloomberg)、路透社(Reuters)所提供之最近價格、成交價、買價或中價加計至計算日前一營業日止應收之利息為準。持有暫停交易或久</p>	第三項第二款	<p>(二)國外之資產：</p> <p>2、債券：大陸地區交易之債券以計算日經理公司於台北時間上午十二點前依序由萬得資訊(Wind)、彭博資訊(Bloomberg)、路透社(Reuters)所提供之最近價格、成交價、買價或中價加計至計算日前一營業日止應收之利息為準；非大陸地區交易之債券以計算日經理公司於台北時間上午十二點前依序由彭博資訊(Bloomberg)、路透社(Reuters)、<u>國外投資顧問公司</u>所提供之<u>第三方機構</u>最近價格、成交價、買價或中價加計至計算日前一營業日止應收之</p>	配合經理公司旗下經理基金之一致性，增訂國外投資機構所提供之價格資訊為淨資產價值取價來源之一。





條 項	原條文	條 項	修正後條文	修訂說明
	無報價與成交資訊者，依序以經理公司評價委員會或洽商其他獨立專業機構提供之公平價格為準。		利息為準。持有暫停交易或久無報價與成交資訊者，依序以經理公司評價委員會或洽商其他獨立專業機構提供之公平價格為準。	

