

# 元大證券投資信託股份有限公司 公告

中華民國 107 年 2 月 23 日

元投信字第 20180289 號

主旨：公告本公司經理之「元大新興亞洲美元債券證券投資信託基金」及「元大美元傘型證券投資信託基金之元大全球美元公司債券證券投資信託基金」合併事宜。

依據：依證券投資信託基金管理辦法第八十五條相關規定辦理。

## 公告事項：

一、金管會核准函日期及文號：中華民國(下同)107 年 2 月 13 日金管證投字第 1070304784 號。

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：「元大新興亞洲美元債券證券投資信託基金」**(本基金有相當比重投資於非投資等級之高風險債券且基金之配息來源可能為本金)** (以下簡稱元大新興亞洲美元債券基金)

(二)基金經理人：謝哲弘

(三)投資策略：

基金投資組合之建立，主要透過經理公司研究團隊對於總體經濟趨勢判斷各國家投資比重、經過殖利率曲線變化與市場信用風險狀況評估後，研判新興亞洲各國美元公司債的配置比例，再依國際情勢針對投資等級債及高收益債券執行各式投資策略分析後建立投資組合，對於投資組合所選擇之投資標的，落實信用風險強化管理政策：

- 1.國家風險評估：參考總體經濟、政府或民間債務、外部償付能力等數據或指標。
- 2.信用風險評估：參考公司基本面、市場流動性、市場技術面等數據或指標。

三、消滅基金之名稱：「元大美元傘型證券投資信託基金之元大全球美元公司債券證券投資信託基金」**(基金之配息來源可能為本金)** (以下簡稱元大全球美元公司債券基金)

四、存續基金與消滅基金之重點說明

項目	元大新興亞洲美元債券基金	元大全球美元公司債券基金
合併情形	存續基金	消滅基金
基金類型	跨國投資債券型	跨國投資債券型
可投資國家	(1)中華民國、中國大陸、韓國、香港、澳門、印度、印尼、菲律賓、新加坡、馬來西亞、泰國、蒙古、孟加拉、哈薩克、越南、寮國、緬甸、柬埔寨、汶萊、斯里蘭卡、巴基斯坦、俄羅斯、土耳其、南非、墨西哥、巴西、哥倫比亞、沙烏地阿拉伯、卡達、阿拉伯聯合大公國。 (2)摩根大通新興市場公司債指數	中華民國、美國、加拿大、奧地利、比利時、盧森堡、法國、德國、西班牙、葡萄牙、義大利、荷蘭、丹麥、芬蘭、挪威、瑞典、瑞士、英國、愛爾蘭、澳洲、紐西蘭、南韓、日本、新加坡、馬來西亞、印尼、印度、中國大陸、香港、澳門、菲律賓、泰國及越南等國。

項目	元大新興亞洲美元債券基金	元大全球美元公司債券基金
	(J.P. Morgan CEMBI Corporate Emerging Markets Bond Index ) 定義成分中所包含之亞洲國家。 (3)美國、澳洲、紐西蘭及英國。	
主要投資標的	美元計價亞洲新興市場國家之債券	美元計價公司債券。
主要投資範圍	投資於國內外美元計價之亞洲新興市場國家債券之總金額不得低於本基金淨資產價值百分之六十(含)，前述所稱亞洲新興市場國家債券係指下列(註)之亞洲新興市場國家或其機構所保證、發行、承銷或註冊掛牌之債券； (註)：本基金所稱亞洲新興市場國家係指摩根大通新興市場公司債指數 (J.P. Morgan CEMBI Corporate Emerging Markets Bond Index ) 定義成分中所包含之亞洲國家	投資於國內外美元計價之公司債券(含金融債券)總金額不得低於本基金淨資產價值之百分之六十。
可否投資高收益債券	可。 <u>(1)投資之高收益債券以亞洲新興市場國家之債券為限，且投資總金額不得超過本基金淨資產價值之百分之四十。</u> <u>(2)投資所在國或地區之國家主權評等未達金管會規定信用評等機構評定等級者，投資該國家或地區之政府債券及其他債券總金額，不得超過本基金淨資產價值之百分之三十。</u> <u>(3)投資於符合美國Rule 144A規定之債券總金額，不得超過本基金淨資產價值之百分之十五。</u>	可。 <u>(1)投資總金額不得超過本基金淨資產價值之百分之十；</u> (2)投資於符合美國 Rule 144A規定之債券者，該債券應附有自買進日起一年內將公開募集銷售之轉換權。
基金風險屬性	<b>RR3</b>	<b>RR2</b>
經理費	1.0%	1.00%
保管費	0.24%	0.25%

## 五、合併目的及預期效益

### (一)合併目的：

綜上，元大新興亞洲美元債券基金(存續基金)可投資範圍為新興亞洲國家而元大全球美元公司債券基金(消滅基金)可投資國家範圍為全球，然兩檔基金主要投資標的均為美元計價之債券，故進行兩檔基金合併，並以元大新興亞洲美元債券基金為存續基金。

前述兩檔基金皆屬跨國投資債券型基金，基於成本效益、基金規模及考量受益人權益等因素下，藉由合併兩檔基金以擴大其基金規模，將使基金資產管理更具經濟規模效益，增加基金資產運用之彈性，有利於提升基金資產管理的效率，同時降低基金管理成本，讓基金資產得到更妥善的運用，以維護受益人之權益。

(二)預期效益：

1.提升基金管理效率，降低投資風險，提升績效表現

兩檔基金合併後，元大新興亞洲美元債券基金(存續基金)因基金規模擴增，可提升經理人操作彈性及靈活度，再加上研究與管理資源會集中在存續基金，將產生更大綜效，使基金經理人進行更有效的資產配置，以分散投資標的，降低投資風險，冀能進一步提升基金績效表現。

2.達成規模經濟效益，減少營運成本，優化產品組合

兩檔基金合併後，可因資產管理達規模經濟效益，使基金之各項交易成本及應行負擔費用降低，減輕受益人的投資成本負擔，透過兩檔基金合併，進一步優化產品組合。

**六、合併基準日：107年5月10日。**

七、消滅基金換發存續基金受益憑證單位數之計算公式

消滅基金各類型受益憑證單位數換發存續基金各類型受益憑證單位數之計算公式如下：

(一)消滅基金受益人原持有消滅基金受益憑證單位數(新臺幣A類型-不配息)可換發存續基金受益憑證單位數(新臺幣A類型-不配息)

＝受益人所持有消滅基金受益憑證單位數(新臺幣A類型-不配息)×〔消滅基金合併基準日單位淨值(新臺幣A類型-不配息)÷存續基金合併基準日單位淨值(新臺幣A類型-不配息)〕

(二)消滅基金受益人原持有消滅基金受益憑證單位數(新臺幣B類型-配息)可換發存續基金受益憑證單位數(新臺幣B類型-配息)

＝受益人所持有消滅基金受益憑證單位數(新臺幣B類型-配息)×〔消滅基金合併基準日單位淨值(新臺幣B類型-配息)÷存續基金合併基準日單位淨值(新臺幣B類型-配息)〕

(三)消滅基金受益人原持有消滅基金受益憑證單位數(美元A類型-不配息)可換發存續基金受益憑證單位數(美元A類型-不配息)

＝受益人所持有消滅基金受益憑證單位數(美元A類型-不配息)×〔消滅基金合併基準日單位淨值(美元A類型-不配息)÷存續基金合併基準日單位淨值(美元A類型-不配息)〕

(四)消滅基金受益人原持有消滅基金受益憑證單位數(美元B類型-配息)可換發存續基金受益憑證單位數(美元B類型-配息)

＝受益人所持有消滅基金受益憑證單位數(美元B類型-配息)×〔消滅基金合併基準日單位淨值(美元B類型-配息)÷存續基金合併基準日單位淨值(美元B類型-配息)〕

**八、(一)元大新興亞洲美元債券基金(存續基金)之風險屬性為RR3。存續基金投資於國內外美元計價之亞洲新興市場國家債券之總金額不得低於基金淨資產價值百分之六十(含)。**

**另，存續基金得投資於高收益債券：**

**1.投資之高收益債券以亞洲新興市場國家之債券為限，且投資總金額不得超過存續基金淨資產價值之百分之四十。**

**2.投資所在國或地區之國家主權評等未達金管會規定信用評等機構評定等級者，投資該國家或地區之政府債券及其他債券總金額，不得超過存續基金淨資產價值之百分之三十。**

**3.投資於符合美國Rule 144A規定之債券總金額，不得超過存續基金淨資產價值之百分之十五。**

(二)元大全球美元公司債券基金(消滅基金)之受益人若無意於合併基準日轉換至元大新興亞洲美元債券基金(存續基金)，得於公告日後至107年5月8日止，向本公司或基金銷售機構提出買回受益憑證申請或轉申購其他基金，並免收轉申購費用；旨揭兩檔基金之受益人未於前述期間提出申請者(以本公司收件日為準)，即表示同意辦理該等基金合併。

九、元大全球美元公司債券基金最後受理單筆申購申請及定時定額扣款日為**107年4月13日**。

十、自**107年05月09日起**至**107年05月10日**期間，為辦理元大全球美元公司債券基金資產全部移轉於元大新興亞洲美元債券基金，停止受理元大全球美元公司債券基金受益憑證之買回申請。

十一、換發新受益憑證之期間、方式及地點

旨揭兩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。

十二、配合旨揭兩檔基金合併並依證券投資信託及顧問法與證券投資信託基金管理辦法之相關規定，受益人如需元大新興亞洲美元債券基金公開說明書，可逕自公開資訊觀測站(<http://mops.twse.com.tw>)或本公司網站(<http://www.yuantafunds.com>)查詢。

十三、如對合併作業有任何疑問，歡迎來電本公司客服專線：0800-009-968。

十四、特此公告。