

摩根新興龍虎企業債券基金與摩根新興市場高收益

債券基金合併事宜 公告

日期：中華民國 107 年 10 月 15 日
字號：摩信（107）發字第 808 號

主旨：本公司經理之「摩根新興龍虎企業債券證券投資信託基金」（以下簡稱「新興龍虎企業債券基金」或「消滅基金」）與「摩根新興市場高收益債券證券投資信託基金」（以下簡稱「新興市場高收益債券基金」或「存續基金」）合併事宜。

說明：

- 一、本合併案業經金融監督管理委員會中華民國（下同）107 年 10 月 2 日金管證投字第 1070336803 號函核准辦理。
- 二、存續基金名稱：新興市場高收益債券基金
- 三、存續基金經理人：郭世宗 先生
- 四、存續基金之投資策略：新興市場高收益債券基金主要鎖定新興市場高收益債的投資機會，並將善用集團研究資源，研判景氣趨勢，進行資產配置。基金經理人亦將隨時留意景氣變化與利率走勢，動態掌握各類債券之投資機會，透過對總體經濟的宏觀看法，選擇在不同經濟環境及景氣循環下，具相對優勢的新興市場債券，並持續追蹤影響債券價格走勢的「利率」及「信用」等因素，積極管理投資策略。基金投資新興市場國家及企業所發行之債券總額不得低於本基金淨資產價值之百分之六十。
- 五、消滅基金名稱：新興龍虎企業債券基金
- 六、合併目的及預期效益：
 - （一）合併目的：

新興龍虎企業債券基金與新興市場高收益債券基金皆屬於海外債券型基金，投資範圍相同，在考量操作成本、效率及受益人權益等因素下，期望透過兩檔基金之合併，使基金淨資產價值達一定經濟規模，並提升基金操作效率與彈性，為全體受益人創造更佳的操作績效。
 - （二）預期效益：
 1. 提升基金資產管理效率：透過基金合併，整合公司相同性質之產品線，除有效提高基金資產管理效率，同時亦提升本公司經營管理之競爭力。

2. 提升基金操作之穩定性：基金合併後，基金規模增加，流動性亦相對增加，基金經理人較不易因受益人申購及贖回交易影響，而被迫調整投資組合。有利於提升基金穩定性，進而提升產品競爭力。

七、 **合併基準日：108年1月18日**

八、 消滅基金最後交易申請日（最後交易日）：108年1月16日；

自108年1月17日起不再受理消滅基金之交易（包含申購、買回及轉申購）

九、 消滅基金換發存續基金受益權單位數之計算公式：

受益人持有消滅基金各類型之受益權單位數 × 各類型合併換發比率。

各類型合併換發比率=（消滅基金各類型受益權單位合併基準日淨資產價值÷消滅基金各類型合併基準日受益權單位數）÷存續基金各類型合併基準日單位淨值

各類型	「新興龍虎企業債券基金」換發「新興市場高收益債券基金」受益權單位之計算公式
累積型受益權單位	「新興龍虎企業債券基金-累積型」受益權單位數 × 累積型合併換發比率 = 可換發「新興市場高收益債券基金-累積型」受益權單位數
	累積型合併換發比率=（「新興龍虎企業債券基金-累積型」合併基準日淨資產價值÷「新興龍虎企業債券基金-累積型」合併基準日受益權單位數）÷「新興市場高收益債券基金-累積型」合併基準日單位淨值
月配息型受益權單位	「新興龍虎企業債券基金-月配息型」受益權單位數 × 月配息型合併換發比率 = 可換發「新興市場高收益債券基金-月配息型」受益權單位數
	月配息型合併換發比率=（「新興龍虎企業債券基金-月配息型」合併基準日淨資產價值÷「新興龍虎企業債券基金-月配息型」合併基準日受益權單位數）÷「新興市場高收益債券基金-月配息型」合併基準

	日單位淨值
--	-------

十、新興龍虎企業債券基金與新興市場高收益債券基金之差異比較：

	新興龍虎企業債券基金 (消滅基金)	新興市場高收益債券基金 (存續基金)
成立日期	101/9/26	100/4/27
保管銀行	彰化商業銀行股份有限公司	中國信託商業銀行股份有限公司
受託管理機構	摩根資產管理(英國)有限公司	摩根資產管理(英國)有限公司
投資標的	新興市場美元企業債券	新興市場美元主權債券為主，並輔以新興市場美元企業債券與新興市場當地貨幣計價主權債券
基金種類	債券型	高收益債券型
風險等級	RR3	RR4
基金規模*	3.22億	12.73億
經理費	1.35%	1.35%
保管費	0.26%	0.26%

註：*截至 107.09.20

十一、「新興龍虎企業債券基金」之受益人若無意於合併基準日轉換至「新興市場高收益債券基金」，得於本公告日起至最後交易日 108 年 1 月 16 日下午 4 點前提出買回申請或轉申購本公司其他投信系列基金，並免收轉申購費用。有辦理「扣款日自由選」投資「新興龍虎企業債券基金」且仍正常扣款之投資人可隨時提前變更扣款投資本公司其他投信系列基金，或是不作任何改變，於兩檔基金合併完成後，由系統自動為投資人改扣「新興市場高收益債券基金」。未於前述期間提出買回或轉申購本公司其他投信系列基金之受益人，則原持有「新興龍虎企業債券基金」各類型受益權單位數將依換發比率全數轉換為「新興市場高收益債券基金」各類型受益權單位數。

十二、原定期(不)定額投資「新興龍虎企業債券基金」之受益人若無意轉扣款「新興市場高收益債券基金」，請於 107 年 12 月 31 日前向本公司提出終止扣款，未提出申請者，將於合併基準日後自動轉扣款「新興市場高收益債券基金」。

-
- 十三、本次基金合併之存續基金風險報酬等級為中高度風險（RR4），若投資人原風險屬性評估結果為中度風險或高度風險，則「新興龍虎企業債券基金」合併至「新興市場高收益債券型基金」後仍可繼續投資；但若投資人原風險屬性評估結果為低度風險者，則合併後新增之交易將受影響，未來將不能新申購「新興市場高收益債券型基金」（含新增扣款日自由選、定期（不）定額增加扣款投資），僅得維持現有定期（不）定額扣款或繼續持有已申購之單位數直至買回。
- 十四、換發新受益憑證期間：消滅基金與存續基金均採無實體發行，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。
- 十五、有關前述基金合併，受益人如需「新興市場高收益債券基金」公開說明書，可逕至公開資訊觀測站（網址：<http://newmops.tse.com.tw>）或摩根資產管理官方網站（網址：<http://www.jpmrich.com.tw>）查詢。