

摩根證券投資信託股份有限公司 公告

日期：中華民國 104 年 1 月 27 日

字號：摩信(104)發字第 78 號

主旨：本公司經理之「摩根新興靈活股債傘型證券投資信託基金之摩根資源活力股票證券投資信託基金」(以下簡稱摩根資源活力股票基金)與「摩根全球 α 證券投資信託基金」(以下簡稱摩根全球 α 基金)合併事宜。

說明：

一、本合併案業經金融監督管理委員會民國104年1月23日金管證投字第1040001330 號函核准辦理。

二、存續基金名稱：摩根全球 α 基金

三、存續基金經理人：葉鴻儒 先生

四、存續基金之投資策略：本基金採用「動態計量模型」(Dynamic Model)，此模型之精神為透過『由下而上』的主動選股策略再輔以被動計量工程嚴格紀律執行，利用股價評比(Value Analysis)、成長率動能(Growth Analysis)、以及企業體質(Quality Analysis)等三項主要評選準則綜合評選找出市場具有投資潛力之標的，將其結果加以分析與檢查其資料準確性再進行投資組合之建置。同時也利用各公開市場投資機構所提供的個股即時獲利數據(即 Earnings Revisions)以及具有強勁價格動能(Price Momentum)之股票等因素納入「動態計量模型」以掌握即時的市場主流趨勢。簡言之，此模型最重要的精神即是透過主動管理智慧及計量模型的紀律控管，達成不只被動地追求與大盤表現同步($\beta \doteq 1$)，更要積極追求主動管理報酬 α 值(指超越大盤之風險調整後報酬)之目標。

五、消滅基金名稱：摩根資源活力股票基金

六、合併目的及預期效益：

(一) 合併目的：

為保障受益人權益、提升投信基金操作規模經濟，按摩根資源活力股票基金信託契約規定，基金淨資產價值最近三十個營業日平均值低於新臺幣壹億元時，即可辦理基金清算作業。因摩根資源活力股票基金之資產規模持續未達新臺幣伍億元，為避免因基金資產規模縮水而面

臨清算，迫使受益人僅得依清算後之價值取回投資之情形，故依據證券投資信託基金管理辦法第八十三條及第八十四條規定，辦理本基金合併，以保障投資人權益。冀望藉由合併，達到維護受益人權益、提升基金管理效率與基金操作績效，強化本公司整體競爭能力之目的。

此次提出之合併案擬將摩根資源活力股票基金併入摩根全球 α 基金，主要是基於這兩檔基金的國家投資範圍一致，可佈局全球市場，皆為跨國股票型基金，在歐美地區之投資比重皆在七成以上；

另外，摩根資源活力股票基金主要投資於基本金屬礦業、黃金礦業及能源公司等天然資源股票，產業配置較為集中，而摩根全球 α 基金的投資範圍更廣，產業配置更分散，除了可參與天然資源股票的投資機會外，還可參與更多樣化的投資機會，提高基金操作之彈性；由於摩根全球 α 基金的投資組合分散，因此波動度更低，可提高基金績效之穩定性。

因此，以摩根全球 α 基金為合併後之存續基金可將對雙方受益人權益之影響降至最低。

(二) 預期效益：

1. 提升基金資產管理效率：透過基金合併，整合公司產品線，期提升基金資產管理效率，同時提高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。有利於基金操作之彈性及基金績效的穩定性。
3. 避免基金面臨清算之風險：維護受益人權益，擴大基金規模，避免因基金資產規模縮水而面臨清算，迫使受益人僅得依清算後之價值取回投資之情形。

七、合併基準日：中華民國(下同) 104 年3 月25日 (星期三)

八、合併基金最後買回及轉申購申請日：104 年3 月23 日 (星期一)；

自104 年3 月24 日起不再受理消滅基金之交易(包含申購、買回及轉換)

九、消滅基金換發存續基金受益權單位數之計算公式：

「摩根資源活力股票基金」之受益人原持有受益權數可換發「摩根全球 α 基金」之受益權單位數 = 受益人持有「摩根資源活力股票基金」之受益權單位數 \times (摩根資源活力股票基金合併基準日單位淨值 \div 摩根全球 α 基金合併基準日單位淨值)

十、摩根資源活力股票基金與存續摩根全球 α 基金之經理費率、保管費率如下：

	摩根資源活力股票基金 (消滅基金)	摩根全球 α 基金 (存續基金)
經理費	2.00%	1.75%
保管費	0.26%	0.26%

十一、「摩根資源活力股票基金」之受益人若無意於合併基準日轉換至「摩根全球 α 基金」，得於本公告日起至 104 年 3 月 23 日止(以本公司收件日為準)，提出買回申請或轉申購其他基金，並免收轉申購費用。逾期則原持有「摩根資源活力股票基金」受益權單位數將依換發比率全數轉換為「摩根全球 α 基金」受益權單位數。

十二、原定時(不)定額投資「摩根資源活力股票基金」投資人若無意轉扣款「摩根全球 α 基金」，請於 104 年 3 月 20 日前向本公司提出終止扣款，否則將於合併基準日後自動轉扣款「摩根全球 α 基金」。

十三、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。

十四、有關前述基金合併，投資人如需「摩根全球 α 基金」公開說明書，可逕至公開資訊觀測站(網址：<http://mops.twse.com.tw>)或摩根資產管理官方網站(網址：<http://www.jpmrich.com.tw>)查詢。