

元大寶來證券投資信託股份有限公司 公告

中華民國 104 年 4 月 20 日

元投信字第 20150483 號

主旨：公告本公司經理之「元大寶來台灣加權股價指數證券投資信託基金」及「元大寶來台股指數證券投資信託基金」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)104 年 4 月 17 日金管證投字第 1040013097 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：元大寶來台灣加權股價指數證券投資信託基金(以下簡稱元大寶來台灣加權股價指數基金)

(二)基金經理人：陳威志

(三)投資策略：

採用指數化策略，將本基金儘可能於扣除各項必要費用之後追蹤標的，原則上儘可能複製標的指數成分股權重，運用最佳化方法管理資產，以追求貼近標的指數之績效表現。但未來在市場狀況允許下，經理公司將不排除以完全複製方式進行指數追蹤。

三、消滅基金之名稱：元大寶來台股指數證券投資信託基金(以下簡稱元大寶來台股指數基金)

四、存續基金與消滅基金之重點說明

項目	元大寶來台灣加權股價指數基金	元大寶來台股指數基金
合併情形	存續基金	消滅基金
基金類型	指數型 (國內投資指數型)	指數型 (國內投資指數型)
可投資國家	中華民國	中華民國
基金投資標的	本基金投資於中華民國之上市及上櫃股票、承銷股票、指數股票型基金、可轉換公司債、債券換股權利證書及進行指數股票型基金之實物申購買回。	本基金投資於中華民國之上市或上櫃股票、承銷股票、台灣存託憑證、指數股票型基金、可轉換公司債、可交換公司債及進行指數股票型基金之實物申購買回。
標的指數	臺灣證券交易所發行量加權股價指數	臺灣證券交易所發行量加權股價指數
投資操作	一、經理公司應採用指數化策略，將本基金儘可能於扣除各項必要費用之後追蹤標的指數之績效表現。 二、前項指數化策略，包含(一)完全複製法及(二)最佳化方法。本基金之操作策略原則上儘可能複製加權指數成分股權重，由於加權指數成分股並不固定，部份成分股流動性不佳，經理公司衡量追蹤成本、追蹤誤差及作業風險	一、本基金採取股票指數化核心策略，搭配合成指數化衛星策略，以追蹤標的指數每日表現為本基金投資組合管理之主要目標。 二、股票指數化核心策略：原則上投資組合儘可能複製標的指數成分股權重，運用效率最佳化方式建構股票投資組合，以追求貼近標的指數之績效表現。由於效率最佳化的指數複製策略方

項目	元大寶來台灣加權股價指數基金	元大寶來台股指數基金
	後，將運用最佳化方法為主要資產管理方式，以追求貼近標的指數之績效表現。但未來在市場狀況允許下，經理公司將不排除以完全複製方式進行指數追蹤。本基金追蹤標的指數表現之操作方式，依最新公開說明書規定。 三、本基金投資於上櫃股票或初次上市股票之承銷股票，限於該上櫃股票及初次上市股票之承銷股票已公布將於證券交易所上市訊息，且經理公司依其專業判斷預期該股票會經指數提供者納入為標的指數成分股。 四、本基金投資於可轉換公司債或債券換股權利證書，限於該標的股票已於臺灣證券交易所上市，或該標的股票已公布將於證券交易所上市訊息。 五、本基金自成立日後第六個營業日追蹤標的指數。	式，不同於選取且複製全部指數成分股權重的完全複製法，乃自所有指數成分股中選取部份而非全部成分股，藉由量化篩選機制以及量化風險控管的流程，建構投資組合。 三、合成指數化衛星策略：本基金以持有成分股票組成的股票指數化核心策略為主，但取得成分股票的方式除了直接買進股票外，亦可透過其他相關金融工具(如期貨、選擇權、指數股票型基金、可轉換公司債或可交換公司債等)間接持有等比例成分股。當期貨、選擇權、指數股票型基金、可轉換公司債或可交換公司債等其他相關金融工具出現相對便宜價格時買進，間接持有等比例成分股或申請轉換成等值之成分股，此可維持追蹤指數的目的及改善成分股流動性問題。因此，本基金運用股票、指數股票型基金、期貨、選擇權以及貨幣市場工具合成貼近標的指數之績效表現的投資組合。 四、本基金自成立日後第十個營業日追蹤標的指數。 五、本基金投資於可轉換公司債及可交換公司債之總金額，不得超過本基金淨資產價值百分之二十(含)。 六、本基金自成立日起屆滿六個月後，投資於上市股票之總金額，不得低於本基金淨資產價值百分之七十(含)。
經理費率	1. 本基金淨資產價值為新臺幣80 億元(含)以下時：0.7%。 2. 本基金淨資產價值超過新臺幣 80 億元(不含)時：0.6%。	1.2%
保管費率	0.1%	0.15%

五、合併目的及預期效益

(一)合併目的：

元大寶來台股指數基金與元大寶來台灣加權股價指數基金均為指數型基金(國內投資指數型)，且均以追蹤臺灣證券交易所發行量加權股價指數績效表現為基金投資組合管理之目標，因考量元大寶來台灣加權股價指數基金之經理費及保管費均低於元大寶來台股指數基金，及基金規模及受益人人數均較大於元大寶來台股指數基金，故建議以元大寶來台灣加權股價指數基金為存續基金。

前述兩檔基金皆屬指數型基金，均以中華民國為投資地區且投資標的屬性類似，基金同質性高，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，增加基金資產運用之彈性，有利於基金管理效率的提昇，同時降低基金交易成本，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.提高基金管理效率，降低投資風險。
- 2.減少營運成本，達成規模經濟效益。

六、合併基準日：104年6月26日。

七、消滅基金換發存續基金受益憑證單位數之計算公式

「元大寶來台股指數基金」之受益人原持有之受益憑證單位數可換發「元大寶來台灣加權股價指數基金」之受益憑證單位數＝元大寶來台股指數基金受益人持有元大寶來台股指數基金受益憑證單位數×(元大寶來台股指數基金合併基準日單位淨值÷元大寶來台灣加權股價指數基金合併基準日單位淨值)。

八、元大寶來台股指數基金之受益人若無意於合併基準日轉換至元大寶來台灣加權股價指數基金，得於公告之日起至104年6月24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、元大寶來台股指數基金單筆申購及定時定額最後扣款日為104年5月29日。

十、自104年6月25日起至104年6月30日期間，為辦理元大寶來台股指數基金資產全部移轉於元大寶來台灣加權股價指數基金，停止受理元大寶來台股指數基金受益憑證之申購及買回。

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，受益人如需元大寶來台灣加權股價指數基金公開說明書，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。