

## 群益證券投資信託股份有限公司

## 公告

中華民國 111 年 9 月 14 日  
 (111)群信字第 1110955 號

**主 旨：**本公司經理之「群益 15 年期以上電信業公司債 ETF 證券投資信託基金」、「群益 15 年期以上科技業公司債 ETF 證券投資信託基金」、「群益 10 年期以上金融債 ETF 證券投資信託基金」、「群益 15 年期以上高評等公司債 ETF 證券投資信託基金」、「群益 15 年期以上公用事業公司債 ETF 證券投資信託基金」、「群益 15 年期以上新興市場主權債 ETF 證券投資信託基金」、「群益 25 年期以上美國政府債券 ETF 證券投資信託基金」、「群益 15 年期以上 A 級美元公司債 ETF 證券投資信託基金」、「群益 15 年期以上 AAA-A 醫療保健業美元公司債 ETF 證券投資信託基金」、「群益 0-1 年期美國政府債券 ETF 證券投資信託基金」及「群益 1-5 年期投資等級公司債 ETF 證券投資信託基金」等 11 檔債券 ETF 證券投資信託基金，調整公開說明書指數評價時間，業經金融監督管理委員會（以下稱金管會）備查在案，特此公告。

**公告事項：**

- 一、旨揭證券投資信託基金修正事項，業經金管會中華民國(下同)111 年 9 月 14 日金管證投字第 1110356280 號函備查在案。
- 二、公告方式：本公告除上傳至投信投顧公會網站 ([www.sitca.org.tw](http://www.sitca.org.tw)) 外，另亦將於本公司網站 ([www.capitalfund.com.tw](http://www.capitalfund.com.tw)) 上公告。
- 三、旨揭證券投資信託基金公開說明書修訂內容如下：

**群益產業型投資等級公司債 ETF 奉型證券投資信託基金之**

**「群益 15 年期以上電信業公司債 ETF 證券投資信託基金」、「群益 15 年期以上科技業公司債 ETF 證券投資信託基金」及「群益 10 年期以上金融債 ETF 證券投資信託基金」**

**公開說明書修正對照表**

條	項	款	修正後條文	條	項	款	修正前條文	說明
壹	十二	一	2.指數編製方式 此三檔子基金之相對應指數 ICE BofA 15+ Year US Telecommunications Index、ICE BofA 15+ Year US Technology & Electronics Index 及 ICE BofA 10+ Year US Banking and Brokerage Index 其指數計算方式相同，採市值加權方法計算，以最新流通在外發行量、市場價格與應計利息進行市值計算，月中還本付息所收到的現金，於指數組成中以現金形式持有，債券每日評價基礎以 IDC 美東下午 4:00	壹	十二	一	2.指數編製方式 此三檔子基金之相對應指數 ICE BofA 15+ Year US Telecommunications Index、ICE BofA 15+ Year US Technology & Electronics Index 及 ICE BofA 10+ Year US Banking and Brokerage Index 其指數計算方式相同，採市值加權方法計算，以最新流通在外發行量、市場價格與應計利息進行市值計算，月中還本付息所收到的現金，於指數組成中以現金形式持有，債券每日評價基礎以 IDC 美東下午 3:00	依據 ICE 指數公司公告調整指數評價時間，以符合實務作業需求。



條	項	款	修正後條文	條	項	款	修正前條文	說明
			買價做計算。指數計算公式如下： (略)				買價做計算。指數計算公式如下： (略)	
參			<a href="#">證券投資信託事業概況</a>	參			<a href="#">證券投資信託事業概況</a>	更新證券投資信託事業概況截至一一一年八月三十一日止。

### 群益投資等級債券 ETF 傘型證券投資信託基金之

#### 「群益 15 年期以上高評等公司債 ETF 證券投資信託基金」、「群益 15 年期以上公用事業公司債 ETF 證券投資信託基金」及「群益 15 年期以上新興市場主權債 ETF 證券投資信託基金」公開說明書修正對照表

條	項	款	修正後條文	條	項	款	修正前條文	說明
壹	十二	一	<p>1. 指數特性  <b>【ICE 15+ Year AAA-AA US Corporate Constrained Index】</b>            Bloomberg Ticker : C81C Index            該指數為在美國市場發行之美元剩餘 15 年期以上美元信用評等 AA-以上的公司債券指數，屬於長天期之高評等的公司債指數，指數表現與長天期公債息息相關，信用利差的波動較小，<b>為</b>風險性相對較小的投資等級公司債指數。  <b>【ICE 15+ Year US Utility excluding Yankee Index】</b>            Bloomberg Ticker : C8QU Index            該指數為美國公司在美國市場發行之美元剩餘 15 年期以上投資等級公用事業公司債券指數，屬於長天期之產業型債券指數，債券信用評等為 BBB- 級以上。  <b>【ICE International 15+ Year US Emerging Markets External Sovereign Index】</b>            Bloomberg Ticker : DG8E Index            該指數為考量國家經濟發展與各國發債量等因素，本指數以 Indonesia 、 Philippines 、 Saudi Arabia 、 Qatar 、 South Africa 、 Russia 、 Turkey 、 Brazil 、 Mexico 、 Colombia 、 Peru 等 11 個新興市場國家發行之美元剩餘 15 年以上美元主權債券為基礎，信用評等屬於 BBB- 級以上投資等級之國家，長天期之新興市場主權債。</p> <p>2. 指數編製方式            ICE 15+ Year AAA-AA US Corporate Constrained Index 、 ICE 15+ Year US Utility excluding Yankee Index 之指數計算方式相同，採市值加權方法計算，以最新流通在外發行量、市場價格與應計利息進行市值計算，月中還本付息所收到</p>	壹	十二	一	<p>1. 指數特性  <b>【ICE 15+ Year AAA-AA US Corporate Constrained Index】</b>            Bloomberg Ticker : C81C Index            該指數為在美國市場發行之美元剩餘 15 年期以上美元信用評等 AA-以上的公司債指數，屬於長天期之高評等的公司債指數，指數表現與長天期公債息息相關，信用利差的波動較小，<b>且該指數涵蓋 5 個產業，是</b>風險性相對較小的投資等級公司債指數。  <b>【ICE 15+ Year US Utility excluding Yankee Index】</b>            Bloomberg Ticker : C8QU Index            該指數為美國公司在美國市場發行之美元剩餘 15 年期以上投資等級公用事業公司債券指數，屬於長天期之產業型債券指數，債券信用評等為 BBB- 級以上。  <b>【ICE International 15+ Year US Emerging Markets External Sovereign Index】</b>            Bloomberg Ticker : DG8E Index            該指數為考量國家經濟發展與各國發債量等因素，本指數以 Indonesia 、 Philippines 、 Saudi Arabia 、 Qatar 、 South Africa 、 Russia 、 Turkey 、 Brazil 、 Mexico 、 Colombia 、 Peru 等 11 個新興市場國家發行之美元剩餘 15 年以上美元主權債券為基礎，信用評等屬於 BBB- 級以上投資等級之國家，長天期之新興市場主權債。</p> <p>2. 指數編製方式            ICE 15+ Year AAA-AA US Corporate Constrained Index 、 ICE 15+ Year US Utility excluding Yankee Index 之指數計算方式相同，採市值加權方法計算，以最新流通在外發行量、市場價格與應計</p>	<p>1. 配合 ICE 指數公司為兼顧實務上作業之正確性與彈性，在不影響指數編製方式下，調整標的指數成分股採納原則之部分內容，酌作內容調整。</p> <p>2. 依據 ICE 指數公司公告調整指數評價時間，以符合實務作業需求。</p>

條	項	款	修正後條文	條	項	款	修正前條文	說明
			的現金，於指數組成中以現金形式持有，債券每日評價基礎以 IDC 美東下午 4:00 買價做計算。而 ICE International 15+ Year US Emerging Markets External Sovereign Index 之指數計算方式則採調整後市值加權方法計算，以國家等權重調整後之發行量、市場價格與應計利息進行市值計算，月中還本付息所收到的現金，於指數組成中以現金形式持有，債券每日評價基礎以 IDC 美東下午 4:00 買價做計算。指數計算公式如下： (以下略)				利息進行市值計算，月中還本付息所收到的現金，於指數組成中以現金形式持有，債券每日評價基礎以 IDC 美東下午 3:00 買價做計算。而 ICE International 15+ Year US Emerging Markets External Sovereign Index 之指數計算方式則採調整後市值加權方法計算，以國家等權重調整後之發行量、市場價格與應計利息進行市值計算，月中還本付息所收到的現金，於指數組成中以現金形式持有，債券每日評價基礎以 IDC 美東下午 3:00 買價做計算。指數計算公式如下： (以下略)	
參			<a href="#">證券投資信託事業概況</a>	參			<a href="#">證券投資信託事業概況</a>	更新證券投資信託事業概況截至一一一年八月三十一日止。

### 群益多元收益傘型證券投資信託基金之

**群益 25 年期以上美國政府債券 ETF 證券投資信託基金公開說明書修正對照表**

條	項	款	修正後條文	條	項	款	修正前條文	說明
壹	十二	一	【群益 25 年期以上美國政府債券 ETF 基金】 2.指數編製方式 ICE 25+ Year US Treasury Index 採市值加權方法計算，以最新流通在外發行量、市場價格與應計利息進行市值計算，月中還本付息所收到的現金，於指數組成中以現金形式持有，債券每日評價基礎以 IDC 美東下午 4:00 買價做計算。 指數計算公式如下： (略)	壹	十二	一	【群益 25 年期以上美國政府債券 ETF 基金】 2.指數編製方式 ICE 25+ Year US Treasury Index 採市值加權方法計算，以最新流通在外發行量、市場價格與應計利息進行市值計算，月中還本付息所收到的現金，於指數組成中以現金形式持有，債券每日評價基礎以 IDC 美東下午 3:00 買價做計算。 指數計算公式如下： (略)	依據 ICE 指數公司公告調整指數評價時間，以符合實務作業需求。
參			<a href="#">證券投資信託事業概況</a>	參			<a href="#">證券投資信託事業概況</a>	更新證券投資信託事業概況截至一一一年八月三十一日止。

### 群益特選債券 ETF 傘型證券投資信託基金之

**「群益 15 年期以上 A 級美元公司債 ETF 證券投資信託基金」及「群益 15 年期以上 AAA-A 醫療保健業美元公司債 ETF 證券投資信託基金」公開說明書修正對照表**

條	項	款	修正後條文	條	項	款	修正前條文	說明
壹	十二	一	2.指數編製方式 ICE 15+ Year Single-A Large Cap Developed Markets US Corporate Index 、 ICE 15+ Year AAA-A Large Cap Developed Markets US Healthcare Index	壹	十二	一	2.指數編製方式 ICE 15+ Year Single-A Large Cap Developed Markets US Corporate Index 、 ICE 15+ Year AAA-A Large Cap Developed Markets US Healthcare Index	依據 ICE 指數公司公告調整指數評價時間，以符合實務作業需求。



條	項	款	修正後條文		條	項	款	修正前條文		說明
			及 ICE 7+ Year Large Cap China Policy Bank Constrained Index 皆採市值加權方法計算，以最新流通在外發行量、市場價格與應計利息進行市值計算，月中還本付息所收到的現金，於指數組成中以現金形式持有。ICE 15+ Year Single-A Large Cap Developed Markets US Corporate Index 及 ICE 15+ Year AAA-A Large Cap Developed Markets US Healthcare Index 債券每日評價基礎以 IDC 美東下午 4:00 買價做計算，ICE 7+ Year Large Cap China Policy Bank Constrained Index 每日是以 IDC 台灣時間下午 5:00 之債券買價作為指數收盤價之計算基礎。指數計算公式如下： (略)					及 ICE 7+ Year Large Cap China Policy Bank Constrained Index 皆採市值加權方法計算，以最新流通在外發行量、市場價格與應計利息進行市值計算，月中還本付息所收到的現金，於指數組成中以現金形式持有。ICE 15+ Year Single-A Large Cap Developed Markets US Corporate Index 及 ICE 15+ Year AAA-A Large Cap Developed Markets US Healthcare Index 債券每日評價基礎以 IDC 美東下午 3:00 買價做計算，ICE 7+ Year Large Cap China Policy Bank Constrained Index 每日是以 IDC 台灣時間下午 5:00 之債券買價作為指數收盤價之計算基礎。指數計算公式如下： (略)		
參			<a href="#">證券投資信託事業概況</a>	參				<a href="#">證券投資信託事業概況</a>		更新證券投資信託事業概況截至一一一年八月三十一日止。

## 群益全方位收益傘型證券投資信託基金之

## 「群益 0-1 年期美國政府債券 ETF 證券投資信託基金」及「群益 1-5 年期投資等級公司債 ETF 證券投資信託基金」公開說明書修正對照表

條	項	款	修正後條文		條	項	款	修正前條文		說明
壹	十二	一	【群益 0-1 年期美國政府債券 ETF 基金】 【群益 1-5 年期投資等級公司債 ETF 基金】 2.指數編製方式 「ICE BofA 0-1 Year US Treasury Index」及「ICE 1-5 Year US Ultra Large Cap Developed Markets Corporate Maximum 6-Year Original Maturity Index」之指數計算方式相同，採市值加權方法計算，以最新流通在外發行量、市場價格與應計利息進行市值計算，月中還本付息所收到的現金，於指數組成中以現金形式持有，投資標的每日評價基礎以 ICE 美東下午 4:00 買價做計算。 指數計算公式如下： (略)		壹	十二	一	【群益 0-1 年期美國政府債券 ETF 基金】 【群益 1-5 年期投資等級公司債 ETF 基金】 2.指數編製方式 「ICE BofA 0-1 Year US Treasury Index」及「ICE 1-5 Year US Ultra Large Cap Developed Markets Corporate Maximum 6-Year Original Maturity Index」之指數計算方式相同，採市值加權方法計算，以最新流通在外發行量、市場價格與應計利息進行市值計算，月中還本付息所收到的現金，於指數組成中以現金形式持有，投資標的每日評價基礎以 ICE 美東下午 3:00 買價做計算。 指數計算公式如下： (略)		依據 ICE 指數公司公告調整指數評價時間，以符合實務作業需求。
參			<a href="#">證券投資信託事業概況</a>	參				<a href="#">證券投資信託事業概況</a>		更新證券投資信託事業概況截至一一一年八月三十一日止。