

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）外，另亦將於本公司網站（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 傘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人、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人、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。

# 群益證券投資信託股份有限公司

CAPITAL INVESTMENT TRUST CORPORATION

106台北市大安區敦化南路二段69號15樓・T. 02 2706 9777・F. 02 2706 5090



讓一群人受益  
群益投信

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</p> <p>【ICE 15+ Year AAA-AA US Corporate Constrained Index】 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，<u>為</u>風險性相對較小的投資等級公司債指數。</p> <p>【ICE 15+ Year US Utility excluding Yankee Index】 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。</p> <p>【ICE International 15+ Year US Emerging Markets External Sovereign Index】 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</p> <p>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</p> <p>【ICE 15+ Year AAA-AA US Corporate Constrained Index】 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，<u>且該指數涵蓋 5 個產業，是</u>風險性相對較小的投資等級公司債指數。</p> <p>【ICE 15+ Year US Utility excluding Yankee Index】 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。</p> <p>【ICE International 15+ Year US Emerging Markets External Sovereign Index】 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</p> <p>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>

# 群益證券投資信託股份有限公司

CAPITAL INVESTMENT TRUST CORPORATION

106台北市大安區敦化南路二段69號15樓・T. 02 2706 9777・F. 02 2706 5090



讓一群人受益  
**群益投信**

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情、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情、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情、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情、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。

# 群益證券投資信託股份有限公司

CAPITAL INVESTMENT TRUST CORPORATION

106台北市大安區敦化南路二段69號15樓・T. 02 2706 9777・F. 02 2706 5090



讓一群人受益  
**群益投信**

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。