

群益證券投資信託股份有限公司

公告

中華民國 113 年 5 月 3 日

(113)群信字第 1130640 號

主旨：本公司經理之「群益台灣精選高息 ETF 證券投資信託基金」(本基金之配息來源可能為收益平準金) (以下稱本基金)調整公開說明書指數編製規則說明，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、本基金修正事項，業經金管會中華民國(下同)113年5月3日金管證投字第 1130339842 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、本基金公開說明書修訂內容如下：

群益台灣精選高息 ETF 證券投資信託基金 (本基金之配息來源可能為收益平準金)

公開說明書修正前後對照表

條	項	款	修正後條文	條	項	款	修正前條文	說明
壹	十二	一	指數編製方式及經理公司追蹤表現之操作方式 本基金所追蹤之標的指數為客製化之「臺灣精選高息指數」，係以臺灣上市上櫃股票為母體，經流動性及指標篩選後，依照股利率由高至低排序並篩選出 30 檔股票。成分股依照股利率加權，輔以流動量指標調整權重，以表彰兼具高股息、獲利能力及流動性之股票投資組合績效表現。 1. 指數編製規則說明 (1) 標的指數成分股的採納原則 ①~③(略) ④權重計算：股利率加權，再依流動量指標調整權重， <u>同時滿足以下條件：</u> <u>A. 個別成分股權重不得超過 10%，且權重下限 0.5%。</u> <u>B. 設定「預擬資產管理規模」為所有追蹤臺灣精選高息指數之資產的 1.2 倍、並無條件進位至新臺幣 250 億元之倍數。使用「預擬資產管理規模」計算個別成分股投資金額，投資金額占發行市值不得超過 6%、且投資金額占自由流通市值不</u>	壹	十二	一	指數編製方式及經理公司追蹤表現之操作方式 本基金所追蹤之標的指數為客製化之「臺灣精選高息指數」，係以臺灣上市上櫃股票為母體，經流動性及指標篩選後，依照股利率由高至低排序並篩選出 30 檔股票。成分股依照股利率加權，輔以流動量指標調整權重，以表彰兼具高股息、獲利能力及流動性之股票投資組合績效表現。 1. 指數編製規則說明 (1) 標的指數成分股的採納原則 ①~③(略) ④權重計算：股利率加權，再依流動量指標調整權重，個別成分股權重不得超過 10%，且權重下限 0.5%。	1. 因應本基金規模成長快速及實務作業需要，調整指數編製之權重計算方式，增訂使用「預擬資產管理規模」計算個股投資金額及比重，並新增每年 2 次進行權重定期審核，以符合實際投資需求。 2. 增訂指數成分股定期審核結果生效後採一定交易日之調整過渡期，以

條	項	款	修正後條文	條	項	款	修正前條文	說明
			<p><u>得超過 15%。</u></p> <p>⑤(略)</p> <p>(2)標的指數成分股的替換原則</p> <p>①每年 2 次進行成分股定期審核，以 5 月第 17 個交易日、12 月的第 7 個交易日為審核基準日，審核資料截至 5 月的第 10 個交易日、11 月最後一個交易日。每次定期審核後選取固定的成分股檔數 30 檔。</p> <p>②成分股調整之緩衝區及檔數替換限制：排名在第 15 名以內之股票即納入成為指數成分股，既有成分股若排名在第 46 名之後則從指數成分股中刪除；處理後，將排名第 16 至 45 名視為候選成分股，以既有成分股優先，按排名挑選成分股。惟 12 月定審時需同時滿足至多替換 8 檔之限制。</p> <p>③<u>每年 2 次進行權重定期審核，2 月及 8 月最後一個交易日為審核資料截止日；若於審核資料截止日，任一成分股權重不符合(一)指數編製方式及經理公司追蹤表現之操作方式、1.、(1)、④所定之權重上限，超過部分將依成分股權重比例重新分配，直至符合(一)指數編製方式及經理公司追蹤表現之操作方式、1.、(1)、④所定之權重上限，並以其後之第 7 個交易日為審核基準日。若無上述逾權重上限之情事，則不處理。</u></p> <p>④<u>成分股定期審核結果，於審核基準日之後，間隔 5 個交易日後生效；於指數定期審核生效日(含)起設有 8 個交易日的指數調整過渡期，將定期審核異動之權重分配在 8 個交易日內調整。</u></p>				<p>⑤(略)</p> <p>(2)標的指數成分股的替換原則</p> <p>①每年 2 次進行成分股定期審核，以 5 月第 17 個交易日、12 月的第 7 個交易日為審核基準日，審核資料截至 5 月的第 10 個交易日、11 月最後一個交易日。每次定期審核後選取固定的成分股檔數 30 檔。</p> <p>②成分股調整之緩衝區及檔數替換限制：排名在第 15 名以內之股票即納入成為指數成分股，既有成分股若排名在第 46 名之後則從指數成分股中刪除；處理後，將排名第 16 至 45 名視為候選成分股，以既有成分股優先，按排名挑選成分股。惟 12 月定審時需同時滿足至多替換 8 檔之限制。</p> <p><b>【新增本項條文】</b></p> <p>③<u>成分股定期審核結果，於審核基準日之後，間隔 5 個交易日後生效。</u></p>	符合實際投資需求；其後項次調整。
參			<u>證券投資信託事業概況</u>	參			<u>證券投資信託事業概況</u>	更新證券投資信託事業概況截至一一三年三月三十一日止。