

群益證券投資信託股份有限公司

公告

中華民國 114 年 4 月 23 日

(114)群信字第 1140374 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且基金並無保證收益及配息**) (以下稱本基金)修訂公開說明書指數編製規則，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、本案係配合臺灣指數股份有限公司之研議調整，爰修訂本基金公開說明書有關指數編製規則相關內容，業經金管會中華民國(下同)114 年 4 月 23 日金管證投字第 1140339355 號函備查在案。本基金指數編製規則之調整，將於 114 年 4 月 30 日生效。
- 二、公告方式：本公告除上傳至中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會網站（www.sitca.org.tw）外，另亦將公告於本公司網站（www.capitalfund.com.tw）。
- 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且基金並無保證收益及配息)

公開說明書修正前後對照表

條 壹	項 五	款 八	修正後條文	條 壹	項 五	款 八	修正前條文	說明
			其他投資標的或特定投資策略之風險 1. ~4. (略) 5. 客製化指數與傳統指數之差異所導致之風險 本指數成分股聚焦於配發高股息且獲利能力佳之 40 檔股票，選入成分股不全是大型龍頭股，在產業配置上與傳統市值型指數也有些不同之處，且本指數採股利率加權方式，與傳統市值型指數採市值加權不同，故當配發高股息之股票漲幅落後大型權值股時，表現會不如傳統市值型指數，反之亦然。 6. (略)				其他投資標的或特定投資策略之風險 1. ~4. (略) 5. 客製化指數與傳統指數之差異所導致之風險 本指數成分股聚焦於配發高股息且獲利能力佳之 30 檔股票，選入成分股不全是大型龍頭股，在產業配置上與傳統市值型指數也有些不同之處，且本指數採股利率加權方式，與傳統市值型指數採市值加權不同，故當配發高股息之股票漲幅落後大型權值股時，表現會不如傳統市值型指數，反之亦然。 6. (略)	配合本基金指數編製規則調整，修訂本處指數成分股之檔數。

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40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 (略) ② 成分股篩選標準： A. 日平均成交金額指標高於8,000萬元，<u>既有成分股日平均成交金額指標高於6,000萬元</u>；若檔數不足150檔，依日平均成交金額指標由大到小補齊。 B. 近四季稅後ROE為正數。 C. 五月定審排除審核資料截止日前董事會未決定發放現金股利金額，或生效日前已除息之年配息股票。 ③ 排序方式： A. 五月定審：依照股利率大小排序，選取前40檔為成分股。 B. 十二月定審：依照預估股利率大小排序，選取前40檔為成分股。 ④ 權重計算：股利率加權，再依流動量指標調整權重，同時滿足以下條件： A. 個別成分股權重不得超過15%，<u>前五大成分股權重總和不得超過65%</u>，且權重下限0.5%。 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得超過15%。 ⑤ (略) (接續下欄)	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 (略) ② 成分股篩選標準： A. 日平均成交金額指標高於8,000萬元；若檔數不足150檔，依日平均成交金額指標由大到小補齊。 B. 近四季稅後ROE為正數。 C. 五月定審排除審核資料截止日前董事會未決定發放現金股利金額，或生效日前已除息之年配息股票。 ③ 排序方式： A. 五月定審：依照股利率大小排序，選取前30檔為成分股。 B. 十二月定審：依照預估股利率大小排序，選取前30檔為成分股。 ④ 權重計算：股利率加權，再依流動量指標調整權重，同時滿足以下條件： A. 個別成分股權重不得超過10%，且權重下限0.5%。 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得超過15%。 ⑤ (略) (接續下欄)	因應本基金規模成長快速及實務作業需要，調整指數編製規則。

條	項	款	修正後條文	條	項	款	修正前條文	說明
壹	十二	一	(2) 標的指數成分股的替換原則 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 <u>40</u> 檔。 ②成分股調整之緩衝區及檔數替換限制：排名在第 <u>20</u> 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 <u>61</u> 名之後則從指數成分股中刪除；處理後，將排名第 <u>21</u> 至 <u>60</u> 名視為候選成分股，以既有成分股優先，按排名挑選成分股。惟需同時滿足至少有 <u>7</u> 檔成分股屬指數母體中發行市值前 <u>50</u> 大，且至少有 <u>20</u> 檔成分股屬指數母體中發行市值前 <u>150</u> 大之限制；12 月定審時另需同時滿足至多替換 8 檔之限制。 ③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。 ④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。 2. (略) 3. (略)	壹	十二	一	(2) 標的指數成分股的替換原則 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 <u>30</u> 檔。 ②成分股調整之緩衝區及檔數替換限制：排名在第 <u>15</u> 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 <u>46</u> 名之後則從指數成分股中刪除；處理後，將排名第 <u>16</u> 至 <u>45</u> 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。 ③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。 ④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。 2. (略) 3. (略)	因應本基金規模成長快速及實務作業需要，調整指數編製規則。
參			證券投資信託事業概況	參			證券投資信託事業概況	更新證券投資信託事業概況截至一一四年三月三十一日止。