

群益證券投資信託股份有限公司

公告

中華民國 114 年 12 月 23 日

(114)群信字第 1141259 號

主 旨：本公司經理之「群益 ESG 20 年期以上 BBB 投資等級公司債 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**）」（證券代號：00937B）（以下稱本基金），部分指數編製規則之異動將於 115 年 1 月 31 日生效，變動後指數成分券檔數之變動比例將超過原檔數達 20% 以上，符合本基金公開說明書所訂之「標的指數發生重大事項」標準，特此公告。

公告事項：

- 一、依據金管會 114 年 12 月 1 日金管證投字第 1140152272 號函、本公司 114 年 12 月 2 日群信字第 1141202 號公告、本基金證券投資信託契約及公開說明書規定辦理。
- 二、本基金所追蹤之標的指數「ICE ESG 20 年期以上 BBB 級成熟市場大型美元公司債（單一產業 10% 上限）指數」，配合指數公司之研議修訂指數編製規則，綜合考量本基金規模持續成長與指數代表性等因素，爰修訂本基金公開說明書有關指數編製規則相關內容，有關債券流通在外金額篩選門檻，由 10 億美元調整至 7.5 億美元，因應接獲指數公司之通知，將自 115 年 1 月 31 日生效。
- 三、承前所述，本基金所追蹤之標的指數部分指數編製規則異動，且變動後指數成分券檔數之變動比例將超過原檔數達 20% 以上，符合本基金公開說明書所訂之「標的指數發生重大事項」標準，據此辦理通知及公告事宜。
- 四、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。
- 五、本基金公開說明書修訂內容如下：

群益 ESG 20 年期以上 BBB 投資等級公司債 ETF 證券投資信託基金

公開說明書指數編製規則修正前後對照表

條	項	款	修正後條文	條	項	款	修正前條文	說明
壹	一	十	投資策略及特色之重點摘述 1.投資策略 (略)。 2.投資特色 (1)(略)。 (2)本基金之標的指數為「ICE ESG 20 年期以上 BBB 級成熟市場大型美元公司債(單一產業 10%上限)指數 (ICE ESG 20+ Year BBB Large Cap Developed Markets US Corporate Constrained Index)」 該指數為在美國市場發行之美元公司債，且篩選條件加入 ESG 風險分數控管，並排除爭議性產業等公司，投資債券信評介於 BBB+~BBB- 級公司債，且剩餘年限超過 20 年，發行人國家為成熟市場，流通在外發行量 <u>7.5</u> 億美元以上之公司債等指數。指數債券流通在外發行量大，且產業設上限 10%，使整體投資組合產業更分散。 (以下略)	壹	一	十	投資策略及特色之重點摘述 1.投資策略 (略)。 2.投資特色 (1)(略)。 (2)本基金之標的指數為「ICE ESG 20 年期以上 BBB 級成熟市場大型美元公司債(單一產業 10%上限)指數 (ICE ESG 20+ Year BBB Large Cap Developed Markets US Corporate Constrained Index)」 該指數為在美國市場發行之美元公司債，且篩選條件加入 ESG 風險分數控管，並排除爭議性產業等公司，投資債券信評介於 BBB+~BBB- 級公司債，且剩餘年限超過 20 年，發行人國家為成熟市場，流通在外發行量 <u>10</u> 億美元以上之公司債等指數。指數債券流通在外發行量大，且產業設上限 10%，使整體投資組合產業更分散。 (以下略)	依據指數公司通知，調整單檔債券流通在外發行量金額。
壹	十二	一	1.指數特性 Bloomberg Ticker：C84LESG Index 本基金之標的指數是客製化指數，該指數為在美國市場發行之美元公司債，且篩選條件加入 ESG 風險分數控管，並排除爭議性產業等公司，投資債券信評介於 BBB+~BBB- 級公司債，且剩餘年限超過 20 年，發行人國家為成熟市場，流通在外發行量 <u>7.5</u> 億美元以上之公司債等指數。指數債券流通在外發行量大，且產業設上限 10%，使整體投資組合產業更分散。 2.指數編製方式 (略)。 3.成分債券之檢視與審核機制 指數基期日期：2018/12/31 指數基期值：100 (1)標的指數成分券的採納原則： ①~④(略)。 ⑤流通在外金額 <u>7.5</u> 億美元以上。 ⑥~⑦(略)。 (以下略)。	壹	十二	一	1.指數特性 Bloomberg Ticker：C84LESG Index 本基金之標的指數是客製化指數，該指數為在美國市場發行之美元公司債，且篩選條件加入 ESG 風險分數控管，並排除爭議性產業等公司，投資債券信評介於 BBB+~BBB- 級公司債，且剩餘年限超過 20 年，發行人國家為成熟市場，流通在外發行量 <u>10</u> 億美元以上之公司債等指數。指數債券流通在外發行量大，且產業設上限 10%，使整體投資組合產業更分散。 2.指數編製方式 (略)。 3.成分債券之檢視與審核機制 指數基期日期：2018/12/31 指數基期值：100 (1)標的指數成分券的採納原則： ①~④(略)。 ⑤流通在外金額 <u>10</u> 億美元以上。 ⑥~⑦(略)。 (以下略)。	依據指數公司通知，調整單檔債券流通在外發行量金額。

條	項	款	修正後條文	條	項	款	修正前條文	說明
壹	十三	三	<p>投資比例配置</p> <p>本基金自上櫃日起，得從事以交易人身分交易衍生自債券之期貨等證券相關商品之交易，以使本基金所投資標的指數成分債券及與標的指數成分債券或美元債券相關之有價證券，並加計證券相關商品之整體曝險部位，能貼近本基金淨資產價值至百分之百（100%），且投資於標的指數成分債券總金額不低於本基金淨資產價值之百分之九十（90%）（含）。</p> <p>本基金以追蹤標的指數之績效表現為目標，以債券發行人國家為成熟市場國家之美元公司債券、剩餘年限超過 20 年、流通在外金額 <u>7.5</u> 億美元以上、固定票息、票面利率大於 4.5%、信評為投資等級 BBB+~BBB-，Sustainalytics ESG 風險分數小於 30 分者，及排除無 Sustainalytics ESG 風險分數者、Sustainalytics 爭議性武器分數大於 20 分之公司、Sustainalytics 成人娛樂分數大於 20 分之公司和菸草與賭博之公司，為成分債券選取標準。（以下略）。</p>	壹	十三	三	<p>投資比例配置</p> <p>本基金自上櫃日起，得從事以交易人身分交易衍生自債券之期貨等證券相關商品之交易，以使本基金所投資標的指數成分債券及與標的指數成分債券或美元債券相關之有價證券，並加計證券相關商品之整體曝險部位，能貼近本基金淨資產價值至百分之百（100%），且投資於標的指數成分債券總金額不低於本基金淨資產價值之百分之九十（90%）（含）。</p> <p>本基金以追蹤標的指數之績效表現為目標，以債券發行人國家為成熟市場國家之美元公司債券、剩餘年限超過 20 年、流通在外金額 <u>10</u> 億美元以上、固定票息、票面利率大於 4.5%、信評為投資等級 BBB+~BBB-，Sustainalytics ESG 風險分數小於 30 分者，及排除無 Sustainalytics ESG 風險分數者、Sustainalytics 爭議性武器分數大於 20 分之公司、Sustainalytics 成人娛樂分數大於 20 分之公司和菸草與賭博之公司，為成分債券選取標準。（以下略）。</p>	依據指數公司通知，調整單檔債券流通在外發行量金額。
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十一月三十日止。