

台中銀證券投資信託股份有限公司 公告

中華民國 112 年 5 月 4 日

主旨：本公司經理之「台中銀台灣主流中小證券投資信託基金」（以下稱台中銀台灣主流中小基金）併入「台中銀台灣優息證券投資信託基金」（以下稱台中銀台灣優息基金）合併事宜公告。

公告事項：

一、金融監督管理委員會核准函日期及文號：中華民國112年5月3日金管證投字第1120337139號函。

二、存續基金名稱：台中銀台灣優息基金。

基金經理人：洪立輝。

存續基金與消滅基金之比較：

基金名稱	台中銀台灣優息基金 存續基金	台中銀台灣主流中小基金 消滅基金
基金類型	國內股票型	國內股票型
經理費	1.60%	1.60%
保管費	0.15%	0.15%
風險等級	RR4	RR5
投資範圍 及方針	<p>1. 本基金投資於中華民國之有價證券為中華民國境內之上市或上櫃公司股票、存託憑證、基金受益憑證（含指數股票型基金、反向型 ETF、商品 ETF 及槓桿型 ETF）、經金管會核准上市或上櫃契約之興櫃股票、政府公債、公司債（含次順位公司債）、無擔保公司債、轉換公司債、交換公司債、金融債券（含次順位金融債券）、依金融資產證券化條例公開招募之受益證券或資產基礎證券、依不動產證券化條例募集之封閉型不動產投資信託基金受益證券或不動產資產信託受益證券及經金管會核准於國內募集發行之國際金融組織債券。</p> <p>2. 原則上，本基金自成立日起三個月後，投資於中華民國境內之上市或上櫃公司股票、存託憑證及經金管會核准上市或上櫃契約之興櫃股票之總額不低於本基金淨資產價值之百分之七十（含）；其中屬於「優息」股票者不得低於本基金淨資產價值之百分之六十（含）。</p>	<p>1. 本基金投資於中華民國境內之上市或上櫃股票（含承銷股票）、基金受益憑證、存託憑證、經金管會核准有價證券上市或上櫃契約之興櫃股票、政府公債、公司債（含次順位公司債）、可轉換公司債、附認股權公司債、無擔保公司債、金融債券（含次順位金融債券）、經財政部或金管會核准於我國境內募集發行之國際金融組織債券、依金融資產證券化條例公開招募之受益證券或資產基礎證券及依不動產證券化條例募集之封閉型不動產投資信託基金受益證券或不動產資產信託受益證券。</p> <p>2. 原則上，本基金自成立日起三個月後，投資於中華民國境內之上市及上櫃股票（含承銷股票）及存託憑證之總額不低於本基金淨資產價值之百分之七十（含）。本基金投資於實收資本額在新臺幣五十億元（含本數）以下之公司所發行之上市或上櫃股票為主，且投資於前述主要投資公司之股票總額不低於本基金</p>

	<p>3. 所謂「優息」股票定義為上市或上櫃公司公布之月營收年成長率由高至低排序前二分之一者，且該股票投資組合以簡單算術平均現金股息殖利率(即現金股息/股價)計算，不得低於所有於證券交易所或證券櫃檯買賣中心上市或上櫃股票之簡單算術平均現金股息殖利率。所謂「月營收」係指該股票之發行公司每月已公布之月營收。所謂「現金股息」係指該股票之發行公司最近一年內已公布(經董事會或股東會通過)之現金股息。所謂「股價」係指該股票於每年六月、十二月最後一個營業日之收盤價。經理公司應於每月第十五個營業日前進行定期檢視該投資標的；但本基金如因定期檢視結果，認有投資標的不符合前述「優息」之認定標準以致生未達前款「優息」股票之投資比例者，經理公司應於一個月內採取適當處置，以符合前款所定投資標的之比例限制。</p>	<p>淨資產價值之百分之六十。前述實收資本額之認定，以投資當時實收資本額為主。本基金所持有前述規定之股票，若所投資公司之實收資本額經增資後逾五十億元時，經理公司在增資公司完成資本額變更登記三個月內，採取適當處置，以符合前述比例之限制。</p>
<p>投資策略</p>	<p>本基金投資於中華民國境內之上市上櫃股票為主，並以下列之選股原則進行投資，同時採行買、賣台股期貨目的在於管理投資組合的貝他值和降低波動度，從而達到本基金穩定入息和長期資本增值之投資目標。</p> <p>本基金股票選股原則：</p> <p>(1) 追求穩定長期績效—公司月營收年成長性大於上市上櫃公司平均成長性，追求長期績效能穩定優於臺灣加權股價指數績效表現。選股期間透過科學化大量分析可投資範圍內的股票，主要因子包含：</p> <p>A、長期公司營運動能：衡量因子包括營收、獲利成長性。目的在於發掘獲利成長穩定和具備其他優質特點的股票。</p> <p>B、短期公司營運風險：衡量因子包括殖利率評估、現金流量表。目的在於發掘具備現金流量健康的高品質股票。</p> <p>(2) 投資組合最適化—在所既定的風險預算下建立最佳投資收益的投資組合。</p> <p>(3) 期貨交易策略—經理公司將依</p>	<p>基金鎖定小且具爆發力之公司，以資本額五十億元以下之中小型股並具e產業者為優先長期投資標的選擇，如政府政策下受惠股、高科技類股、高成長性、具轉機潛力、景氣循環股、擁有領先地位、世界競爭優勢及被市場低估其價值之公司等。在選股不選市的投資策略下，主流趨勢中具高度成長爆發力之中小型公司搭配穩健成長的大型績優股，將提供基金獲利成長雙引擎！</p>

	據市況動態調整期貨多頭、空頭部位，以追求最佳的長期資本增值機會、消除投資組合的貝他值及波動度，並以此達成投資目標。	
--	---	--

三、消滅基金之名稱：台中銀台灣主流中小基金。

四、合併目的及預期效益：

(一)合併目的

- 1、同類型基金之合併，將提升單一基金規模，各項成本皆可因此降低，在基金控管及作業方面也相對單純化，並且也有利於基金對於各項投資項目比率的控管。
- 2、基金之合併，一方面有利於基金各項操作，另一方面則可以將公司的資源如研究品質與管理資源更集中於存續基金當中，進而提升基金效率。此外，合併後基金規模的增加，將有利於各項投資比重的控管，進而提升資產的經營及操作效益。

(二)預期效益

- 1、成本之經濟效益：
基金合併的目的在於提高資產管理之經濟規模。
- 2、降低投資風險及提高資產管理績效：
有利於基金經理人做最有效之資產配置，分散投資風險，並使在資產管理上做更充份的運用。
- 3、維持基金的流動性及穩定性：
合併後之規模增加，將有助於基金之流動性及穩定性之提升，且避免基金面臨清算風險，迫使受益人退出，影響受益人權益。

五、合併基準日：中華民國112年6月26日。

六、消滅基金換發存續基金受益憑證單位數之計算公式：

消滅基金之受益人原持有受益權單位數可換發存續基金之受益權單位數
=原消滅基金受益人持有消滅基金受益憑證單位數×(消滅基金合併基準日單位淨值÷存續基金合併基準日單位淨值)

(* 實際換發比率以合併基準日淨值計算之，其換發受益權單位數不足1單位者，四捨五入計算至小數點以下第二位止。)

註：上述基金之換發皆為累積型新台幣之受益權單位數。

七、不同意基金合併之受益人得於本公告日後至112年6月20日止向本公司提出買回受益憑證申請。

原定期定額投資於「台中銀台灣主流中小基金」之受益人，得於112年6月12日前向本公司提出終止扣款，若未於前述期間提出申請者，即表示同意於合併基準日後自動轉扣款「台中銀台灣優息基金」。

八、本公司自112年6月21日起至「台中銀台灣主流中小基金」資產全部移轉於「台中銀台灣優息基金」之日止，停止受理「台中銀台灣主流中小基金」受益憑證之申購及買回。

九、換發新受益憑證之期間、方式與地點：消滅基金與存續基金均採無實體發行，不印製實體受益憑證。本公司將依據受益憑證事務處理規則、有價證券集中保管帳簿劃撥作業辦法及證券集中保管事業之相關規定辦理後續受益憑證劃撥轉換事宜。

十、有關前述基金合併，並依證券投資信託及顧問法與證券投資信託基金管理辦法之相關規定

，受益人如需「台中銀台灣優息基金」公開說明書，請逕至公開資訊觀測站（網址：<https://mops.twse.com.tw>）或本公司網站（網址：<https://www.tcbsitc.com.tw>）查詢。

十一、特此公告。