

兆豐台美動能股債平衡ETF證券投資信託基金
(基金之配息來源可能為收益平準金)

簡式公開說明書(申報用稿本)

刊印日期：114年10月

- (一) 本簡式公開說明書係公開說明書之重點摘錄，相關名稱及文字定義與公開說明書完全相同。
 (二) 投資人申購本基金後之權利義務詳述在公開說明書，投資人如欲申購本基金，建議參閱公開說明書。

壹、基本資料			
基金名稱	兆豐台美動能股債平衡ETF證券投資信託基金 (基金之配息來源可能為收益平準金)	成立日期	114年 月 日
經理公司	兆豐國際證券投資信託(股)公司	基金型態	開放式
基金保管機構	元大商業銀行(股)公司	基金種類	指數股票型
受託管理機構	無	投資地區	中華民國及外國
國外投資顧問公司	無	存續期間	不定期限
收益分配	半年配息	計價幣別	新臺幣
績效指標 benchmark	本基金之標的指數為臺灣指數公司彭博台美動能多資產平衡指數，本指數為客製化及 Smart Beta 指數，指數相關資訊請詳閱本基金公開說明書第 32-33 頁	保證機構	無(本基金非保證型基金)
		保證相關重要資訊	無

貳、基金投資範圍及投資特色

一、投資範圍：

本基金投資於中華民國及外國之有價證券。經理公司係採用指數化策略，將本基金於扣除各項必要費用後儘可能追蹤標的指數之績效表現為操作目標。為達成前述操作目標，本基金自上市日起追蹤標的指數，投資於標的指數成分證券之總金額應達本基金淨資產價值之百分之九十(含)以上，另為貼近本基金之追蹤目標及資金調度需要，本基金得進行證券相關商品交易及投資其他有價證券以使基金投資組合整體曝險盡可能貼近基金淨資產規模之百分之一百。

(一) 標的指數之簡介：臺灣指數公司彭博台美動能多資產平衡指數，依據現代投資組合理論的觀點，不同資產之間若呈現低相關性，便可降低整體組合的波動率，進而改善風險調整後的投資績效。本指數結合股票與債券的特質，區分市場情境，設定股債比例，塑造兼具分散風險與追求穩健收益的多資產投資策略，表彰結合股票與債券投資組合之績效表現。

(二) 標的指數與傳統指數之差異：本基金標的指數-臺灣指數公司彭博台美動能多資產平衡指數，其與代表性指數-臺灣加權指數及彭博美國政府公債指數差異，如採樣範圍差異、篩選方式差異、排序方式差異及權重差異等。

二、投資特色：

(一) 直接投資：本基金採指數化策略至少 90% 以上之資產將直接投資於臺灣上市、上櫃股票及美國公債，將本基金扣除各項必要費用後儘可能追蹤「臺灣指數公司彭博台美動能多資產平衡指數」表現為投資組合管理目標，同時考量貼近基金追蹤目標需要，輔以交易證券相關商品，期使整體曝險部位能貼近基金淨資產價值之 100%。該指數結合股票與債券的特質，區分市場情境，設定股債比例(投資組合比例將依情境指標不同而調整，股票為 80% 至 20% 之間，債券為 20% 至 80% 之間)，運用「臺灣指數公司特選臺灣上市上櫃動能趨勢指數」與「彭博 20 年期以上美國公債指數(台幣計價)」之成份證券，塑造兼具分散風險與追求穩健收益的股債投資策略，表彰結合股票與債券投資組合績效表現也降低波動風險，為投資人提供新的投資選擇。

(二) 投組透明：本基金將每日公告投資組合成分證券清單，並於盤中交易時段發佈基金即時預估淨值，同時，指數提供者亦會定期或不定期發佈基金標的指數之最新成分證券相關資訊，資訊相對透明，有助投資人判斷投資機會與風險。

(三) 交易方便：本基金屬於指數股票型基金，於臺灣證券交易所上市，投資人可於國內股市交易時間以即時市場價格交易本基金，交易方式便利且即時。

參、投資本基金之主要風險

- 一、本基金為指數股票型基金，所追蹤標的指數為臺灣指數公司彭博台美動能多資產平衡指數(Bloomberg TIP Taiwan and US Momentum Balanced Multi-Asset Index) 表現為基金投資組合管理之目標，基金投資國家之政治、經濟或法令等相關投資規定若改變時，亦存在一定程度之投資風險，雖投資指數股票型基金具有分散各標的風險效果，惟仍具有相當程度的風險，投資人仍應注意所有投資本基金之風險。本基金可能面臨之投資風險包含：產業景氣循環風險、流動性風險、外匯管制及匯率變動風險、投資地區政治、經濟變動風險等，參酌中華民國投信投顧公會之基金風險報酬等級分類標準，故風險報酬等級為RR4*。
- 二、本基金以追蹤標的指數報酬為操作目標，而標的指數之成分證券價格波動將影響標的指數的走勢，當標的指數的成分證券價格波動劇烈或變化時，本基金之淨資產價值亦承受大幅波動的風險。
- 三、本基金所追蹤之標的指數為客製化指數，係屬SmartBeta指數，該指數之特性及傳統指數間之差異可能會導致指數型商品在持成分證券配置上偏重於例如特定主題、性質、大小規模等之債券，使指數型商品績效表現未必適宜與傳統指之表現比較等相關風險，並「不保證該客製化指數績效在任何時候的表現優於市場行情，指數績效亦可能落後市值加權指數或其他績效指標，且持續時間未知」。「追蹤客製化指數及SmartBeta指數，相較於追蹤值加權指數之基金，可能有相當比例持股投資於市值較小之公司」。「客製化指數及Smart Beta指數與傳統指數之差異及差異導致之風險，請詳閱本基金公開說明書第32-33頁。
- 四、有關本基金運用限制及投資風險之揭露請詳見第17頁至第19頁及第27頁至第33頁。
*風險報酬等級為本公司依投信投顧公會「基金風險報酬等級分類標準」編製，該分類標準係計算過去5年基金淨值波動度標準差，以標準差區間予以分類等級，分類為RR1-RR5五級，數字越大代表風險越高。此等級分類係基於一般市場狀況反映市場價格波動風險，無法涵蓋所有風險(如：基金計價幣別匯率風險、投資標的產業風險、信用風險、利率風險、流動性風險等)，不宜作為投資唯一依據。投資人仍應注意所投資基金個別的風險。請投資人注意申購基金前應詳閱公開說明書，充分評估基金投資特性與風險，更多基金評估之相關資料(如年化標準差、Alpha、Beta及Sharp值等)可至投信投顧公會網站之「基金績效及評估指標查詢專區」(https://www.sitca.org.tw/index_pc.aspx)查詢。

肆、本基金適合之投資人屬性分析

本基金為指數股票型基金，結合股票與債券的特質，區分市場情境，設定股債比例，運用「臺灣指數公司特選臺灣上市上櫃動能趨勢指數」與「彭博 20 年期以上美國公債指數(台幣計價)」，塑造兼具分散風險與追求穩健收益的多資產投資策略，達到較佳的風險調整後收益表現。雖指數組合已經篩選達分散性，惟仍具有相當程度的風險，投資人仍應注意所有投資本基金之風險，本基金適合追求長期資本增值且能承受標的指數價格波動之風險非保守型投資人。

伍、基金運用狀況

一、基金淨資產組成：

不適用，本基金為首次募集。

二、最近十年度基金淨值走勢圖：

不適用，本基金為首次募集。

三、最近十年度各年度基金報酬率：不適用，本基金為首次募集。

四、基金累計報酬率：不適用，本基金為首次募集。

五、最近十年度各年度每受益權單位收益分配之金額：不適用，本基金為首次募集。

六、最近五年度各年度基金之費用率：不適用，本基金為首次募集。

陸、受益人應負擔費用之項目及其計算方式

項目	計算方式或金額	
經理費	按本基金淨資產價值每年百分之零點捌（0.8%）之比率，逐日累計計算，並自本基金成立日起每曆月給付乙次。	
保管費	基金保管機構之報酬（含支付國外受託保管機構之費用及報酬）係按本基金淨資產價值依下列比率，由經理公司逐日累計計算，自本基金成立日起每曆月給付乙次： 1. 本基金淨資產價值於新臺幣伍拾億元（含）以下時，按每年百分之零點壹捌（0.18%）之比率計算。 2. 本基金淨資產價值超過新臺幣伍拾億元，且於新臺幣壹佰億元（含）以下時，按每年百分之零點壹陸（0.16%）之比率計算。 3. 本基金淨資產價值超過新臺幣壹佰億元時，按每年百分之零點壹肆（0.14%）之比率計算。	
指數授權費	於「上市日」起，甲方將於每曆季季末按下列項目合計之總金額向乙方請款，乙方應全額支付： 1. 該曆季日平均淨資產之0.0095%；及 2. 每曆季指數授權費美金3,750元；不足一曆季者，則按實際日數比例計算之。 3. 自指數授權契約生效日起，每屆滿一週年後六十日內，指數提供者得以書面通知經理公司調漲前述指數授權費，但每年之漲幅以前一週年之百分之二十為限。經理公司得於收受前述書面通知後三十日內，以書面通知指數提供者不同意調漲後費用並立即終止指數授權契約。	
上市費及年費	1. 上市審查費：新臺幣10萬元。 2. 上市年費：本基金資產規模之0.03%，每年最高上限為新臺幣30萬元。	
召開受益人會議費用	非每年固定召開，每次預估新臺幣100萬元。(註1)	
其他費用	以實際發生之數額為準。(註2)	
透過初級市場申購	申購手續費 (成立日前)	最高不得超過每受益權單位淨資產價值之2%。實際適用費率由經理公司依其銷售策略在該範圍內調整訂定之。
申購手續費 (上市日起)	最高不得超過每受益權單位淨資產價值之2%。實際適用費率由經理公司依其銷售策略在該範圍內調整訂定之。本基金申購基數為伍拾萬個受益權單位數。每一申購之受益權單位數應為申購基數或其整倍數。	
申購交易費	申購交易費 = 實際申購價金 × 申購交易費率 目前本基金申購交易費率收取標準為0.10%，前述本基金申購交易費率得依有價證券市場現況（含匯率波動）、投資組合交易部位需要調整，最高以2%為限，依最新公開說明書規定辦理。	
買回手續費	最高不得超過每受益權單位淨資產價值之2% 現行之買回手續費為每買回基數(註3)	
買回交易費	買回交易費 = 買回價金 × 買回交易費率 目前本基金買回交易費率收取標準為0.10%，前述本基金買回交易費率得依有價證券市場現況（含匯率波動）、投資組合交易部位需要調整，最高以2%為限，依最新公開說明書規定辦理。	
買回費用	無	
買回收件手續費	無	
行政處理費	申購人若發生申購失敗、受益人若發生買回失敗時，應支付行政處理費。	

(註1) 受益人會議並非每年固定召開，故該費用不一定每年發生。

(註2) 包括依信託契約規定運用本基金所生之經紀商佣金、交易手續費等直接成本及必要費用；本基金應支付之一切稅捐、基金財務報告簽證及核閱費用；清算費用及訴訟或非訴訟所產生之費用。(請參閱本公開說明書【證券投資信託契約主要內容】一捌之說明)

(註3) 上市(含當日)後基金每申購買回基數為50萬個受益權單位數。

(註4) 指數授權費用變更時之因應處理程序及影響，請詳閱本基金公開說明書第45頁。

柒、受益人應負擔租稅之項目及其計算

本基金投資國內資本市場之稅賦事項，均依財政部有關法令辦理，受益人可能負擔之租稅主要包括本基金所投資商品之各項交易稅及所得稅款等；另本基金如投資國外資本市場，所產生之各項所得，應各投資所在國或地區相關法令規定繳納各項稅費，且可能無法退回。詳細內容請參見本基金公開說明書第 46 頁。

捌、基金淨資產價值之公告時間及公告方式

- 一、公告時間：經理公司應於每營業日公告前一營業日本基金每受益權單位之淨資產價值。
- 二、公告方式：於經理公司網站 (<https://www.megafunds.com.tw>)，及中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會網站(<http://www.sitca.org.tw>)公告。

玖、公開說明書之取得

- 一、本基金公開說明書備置於經理公司及其基金銷售機構營業處所，投資人可免費索取。
- 二、投資人亦可於經理公司網站 (<https://www.megafunds.com.tw>) 及公開資訊觀測站 (<https://mops.twse.com.tw>) 免費取得本基金公開說明書及基金近年度財務報告電子檔。

拾、其他

兆豐投信服務電話：(02) 2175-8388

投資警語：

- 一、本基金經金融監督管理委員會或其指定機構同意生效，惟不表示本基金絕無風險。基金經理公司以往之經理績效不保證本基金之最低投資收益；基金經理公司除盡善良管理人之注意義務外，不負責本基金之盈虧，亦不保證最低之收益，投資人申購前應詳閱基金公開說明書。
- 二、本基金自成立日起至上市日前（不含當日），經理公司不接受本基金受益權單位數之申購或買回。本基金受益憑證之上市買賣，應依證券交易市場有關規定辦理。
- 三、本基金自上市日（含當日）起之申購，經理公司將依本公開說明書規定依本基金「現金申購買回清單」所載之「每申購買回基數約當淨值」加計 110%（依本基金規定辦理），向申購人預收申購。惟如遇臺灣證券市場連續休假日之情事者，前述一定比例之比重得由經理公司於公告後機動調整，並應於調整後三個營業日內恢復本基金規定之比例。
- 四、**本基金收益分配採半年配息機制，基金配息不代表基金實際報酬，且過去配息不代表未來配息；基金淨值可能因市場因素而上下波動。本基金配息可能由基金的收益或收益平準金中支付。任何涉及由收益平準金支出的部份，可能導致原始投資金額減少。本基金淨值組成項目，可於經理公司網站查詢。**
- 五、本公開說明書之內容如有虛偽或隱匿之情事者，應由本證券投資信託事業與負責人及其他曾在公開說明書上簽章者依法負責。
- 六、本基金不受存款保險、保險安定基金或其他相關保障機制之保障，投資人需自負盈虧。故投資本基金可能發生部份或全部本金之損失，最大可能損失則為全部投資金額。金融消費爭議處理及申訴管道：就本公司所提供之金融商品或服務所生紛爭投資人應先向本公司提出申訴，若三十日內未獲回覆或投資人不滿意處理結果得於六十日內向「金融消費評議中心」申請評議。
- 七、指數編製公司免責聲明：
「臺灣指數公司彭博台美動能多資產平衡指數」係由臺灣指數股份有限公司(臺灣指數公司)及 Bloomberg Index Services Limited (以下稱 BISL) (以上機構合稱「合作單位」)共同開發，並由臺灣指數公司單獨授權兆豐國際證券投資信託股份有限公司使用。「合作單位」並未以任何方式贊助、背書、出售或促銷「兆豐台美動能股債平衡 ETF 證券投資信託基金(基金之配息來源可能為收益平準金)」，且「合作單位」亦未明或默示對使用指數之結果及/或指數於任一特定日期之任一特定時間或其他時間之數據提供任何保證或聲。指數係由臺灣指數公司所計算。然「合作單位」就指數之任何錯誤、不正確、遺漏或指數資料之傳輸斷對任何人均不負任何責任，且無任何義務將該等錯誤、不正確或遺漏通知任何人。