中國信託投信
CTBC INVESTMENTS

中國信託證券投資信託股份有限公司 公告

中華民國 110 年 10 月 5 日

中信(投信)字第 11010210001 號

主旨：本公司經理之「中國信託中國外資自由投資50不含A及B股傘型ETF證券投資信託基金」(以下稱本傘型基金)之兩檔子基金申請修訂證券投資信託契約及本傘型基金公開說明書乙案，業經金融監督管理委員會(以下簡稱金管會)核准，謹此公告。

說明：

一、依金管會110年10月4日金管證投字第1100352359號函辦理及各子基金證券投資信託契約之公告規定辦理。

二、本傘型基金包含「中國信託中國外資自由投資50不含A及B股傘型ETF證券投資信託基金之中國信託MSCI中國外資自由投資50不含A及B股ETF證券投資信託基金」及「中國信託中國外資自由投資50不含A及B股傘型ETF證券投資信託基金之中國信託MSCI中國外資自由投資50不含A及B股單日正向2倍ETF證券投資信託基金」(以下簡稱各子基金)。

三、各子基金業依中信顧字第 1100050236 號函文規定，於基金信託契約「通知及公告」條文中增訂基金應通知受益人事項及應公告事項等相關規定。

四、本次修訂事項，自本公告日之翌日起生效。

五、本公告同時登載於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)及本公司網站(www.ctbcinvestments.com)；修正後公開說明書亦可至本公司網站或公開資訊觀測站(mops.tse.com.tw)查詢。

六、各子基金證券投資信託契約及本傘型基金公開說明書修訂內容如下：

「中國信託中國外資自由投資 50 不含 A 及 B 股傘型 ETF 證券投資信託基金之中國信託 MSCI 中國外資自由投資 50 不含 A 及 B 股 ETF 證券投資信託基金」

證券投資信託契約修訂對照表

條	項	款	修正後條文	條	項	款	原條文	說明
第三十二條			通知及公告	第三十二條			通知及公告	
32	1	8	本基金標的指數發生重大事項，對受益人有重大影響者。				(新增。其後款次依序調整)	依 110 年 2 月 23 日中信顧字第 1100050236 號函規定增訂之。
32	2	10	其他重大應公告事項(如基	32	2	10	其他重大應公告事項(如	同上。

			金所持有之有價證券或證券相關商品，長期發生無法交割、移轉、平倉或取回保證金情事；本基金所投資標的指數成分證券檔數或期貨交易部位曝險比率與所追蹤標的指數編製成分證券檔數或曝險比率有重大差異者；本基金所投資標的指數成分證券及期貨交易部位之調整，導致基金績效與標的指數表現之追蹤差距(Tracking Difference)有重大差異者)。				基金所持有之有價證券或證券相關商品，長期發生無法交割、移轉、平倉或取回保證金情事)。	

「中國信託中國外資自由投資 50 不含 A 及 B 股傘型 ETF 證券投資信託基金之中國信託 MSCI 中國外資自由投資 50 不含 A 及 B 股單日正向 2 倍 ETF 證券投資信託基金」證券投資信託契約修訂對照表

條	項	款	修正後條文	條	項	款	原條文	說明
第三十二條			通知及公告	第三十二條			通知及公告	
32	1	8	本基金標的指數發生重大事項，對受益人有重大影響者。				(新增。其後款次依序調整)	依 110 年 2 月 23 日中信顧字第 1100050236 號函規定增訂之。
32	2	10	其他重大應公告事項(如基金所持有之有價證券或證券相關商品，長期發生無法交割、移轉、平倉或取回保證金情事；本基金所投資標的指數成分證券檔數或期貨交易部位曝險比率與所追蹤標的指數編製成分證券檔數或曝險比率有重大差異者；本基金所投資標的指數成分證券及期貨交易部位之調整，導致基金績效與標的指數表	32	2	10	其他重大應公告事項(如基金所持有之有價證券或證券相關商品，長期發生無法交割、移轉、平倉或取回保證金情事)。	同上。

			現之追蹤差距(Tracking Difference)有重大差異者)。					

「中國信託中國外資自由投資50不含A及B股傘型ETF證券投資信託基金」基金公開說明書修訂前後對照表

條款項次	修正後	修正前	說明
【基金概況】/拾、基金之資訊揭露/一、依法令及信託契約規定應揭露之資訊內容/(二)	經理公司或基金保管機構應通知受益人之事項如下： 1.~7（略） 8. 各子基金標的指數發生重大事項(註1)，對受益人有重大影響者。 9. 其他依有關法令、金管會之指示、各子基金信託契約或參與契約規定、臺灣證交所規定、證券集中保管事業之規定或經理公司、基金保管機構認為應通知受益人之事項。	經理公司或基金保管機構應通知受益人之事項如下： 1.~7.（略） 8. 其他依有關法令、金管會之指示、各子基金信託契約或參與契約規定、臺灣證交所規定、證券集中保管事業之規定或經理公司、基金保管機構認為應通知受益人之事項。	配合各子基金信託契約第32條第1項第8款內容增訂。
【基金概況】/拾、基金之資訊揭露/一、依法令及信託契約規定應揭露之資訊內容/(三)	經理公司或基金保管機構應公告之事項如下： 1.~9. (略) 10.其他重大應公告事項(如基金所持有之有價證券或證券相關商品，長期發生無法交割、移轉、平倉或取回保證金情事；基金所投資標的指數成分證券檔數或期貨交易部位曝險比率與所追蹤標的指數編製成分證券檔數或曝險比率有重大差異(註2)者；基金所投資標的指數成分證券及期貨交易部位之調整，導致基金績效與標的指數表現之追蹤差距(Tracking Difference)有重大差異(註3)者)。 前揭第4及第5款規定應公佈之內容及比例，如因有關法令或相關規定修正者，從其規定。	經理公司或基金保管機構應公告之事項如下： 1.~9. (略) 10.其他重大應公告事項(如基金所持有之有價證券或證券相關商品，長期發生無法交割、移轉、平倉或取回保證金情事)。 前揭第4及第5款規定應公佈之內容及比例，如因有關法令或相關規定修正者，從其規定。	配合各子基金信託契約第32條第2項第10款內容增訂。

	【註 1】:所稱標的指數發生「重大事項」係指： (1)指數提供者停止提供標的指數或指數授權契約被終止； (2)指數提供者停止編製標的指數； (3)標的指數編製規則調整致重大影響或改變本基金投資基本方針； (4)其它依有關法令、金管會之指示或經理公司認為應通知之事項。 【註 2】:所稱 ETF 成分證券檔數或期貨交易部位曝險比率與所追蹤標的指數編製成分證券檔數或曝險比率有「重大差異」係指： 【中國信託 MSCI 中國外資自由投資 50 不含 A 及 B 股 ETF 證券投資信託基金】 基金所投資證券與所追蹤標的指數成分證券檔數覆蓋率低於 90%，視為重大差異。 惟標的指數成分證券定期調整生效日之前後五個基金營業日期間、本基金信託契約業經金管會及台灣證交所同意終止及下市後或遇不可抗力之因素(如：國內外股票/匯率市場暫停交易、匯兌交易受限制、成分證券流動性過低致無法交易所需部位、指數公司發佈指數值時間延遲或不正確等)時，不在此限。 【中國信託 MSCI 中國外資自由投資 50 不含 A 及 B 股單日正向 2 倍 ETF 證券投資信託基金】 基金資產(有價證券+期貨)整體曝險比率高於 220%或低於 180%視為重大差異。 惟標的指數成分證券定期調整		新增各子基金所稱標的指數發生「重大事項」、ETF 成分證券檔數或期貨交易部位曝險比率與所追蹤標的指數編製成分證券檔數或曝險比率有「重大差異」及 ETF 成分證券及期貨交易部位之調整，導致基金績效與標的指數表現之追蹤差距(Tracking Difference)有「重大差異」等定義。

	生效日之前後五個基金營業日期間、本基金信託契約業經金管會及台灣證交所同意終止及下市後或遇不可抗力之因素(如：國內外股票/匯率市場暫停交易、匯兌交易受限制、成分證券流動性過低或可供交易期貨口數不足致無法交易所需部位、指數公司發佈指數值時間延遲或不正確等)時，不在此限。 【註 3】:所稱 ETF 成分證券及期貨交易部位之調整，導致基金績效與標的指數表現之追蹤差距(Tracking Difference)有「重大差異」係指： 【中國信託 MSCI 中國外資自由投資 50 不含 A 及 B 股 ETF 證券投資信託基金】 **以基金所定之每年度負追蹤差距控點的 2 倍內為限。目前所訂標準為單一年度內累計追蹤差距達負 6%以上者**，視為重大差異。 惟該差異造成之原因如為標的指數與基金會計評價基礎不同、市場因素等合理情況或其他不可抗力之因素(如：國內外股市/匯率市場暫停交易或匯兌交易受限制、成分證券流動性過低致無法交易所需部位等)者，不在此限。 【中國信託 MSCI 中國外資自由投資 50 不含 A 及 B 股單日正向 2 倍 ETF 證券投資信託基金】 **以基金所定之每年度負追蹤差距控點的 2 倍內為限。目前所訂標準為單一年度內累計追蹤差距達負 10%以上者**，視為重大差異。 惟該差異造成之原因如為近遠月期現貨價差、標的指數與基金		

	會計評價基礎不同、市場因素等合理情況或其他不可抗力之因素(如：國內外股市/匯率市場暫停交易或匯兌交易受限制、成分證券流動性過低或可供交易期貨口數不足致無法交易所需部位等)者，不在此限。 ※「累計追蹤差距」計算公式=當期基金報酬率%-當期標的指數報酬率%。 (1)當期基金報酬率%= (最近營業日之基金每受益權單位淨資產價值-前一年度 12 月底最後一個營業日之基金每受益權單位淨資產價值) / 前一年度 12 月底最後一個營業日之基金每受益權單位淨資產價值。 (2)當期標的指數報酬率% = (最近營業日之標的指數收盤價-前一年度 12 月底最後一個營業日之標的指數收盤價) / 前一年度 12 月底最後一個營業日之標的指數收盤價。 前述【註 1】~【註 3】所訂之重大事項或重大差異，經理公司仍得視交易市場現況或基金投資操作所需之考量進行檢視，並於報請金管會核備後調整之。		
【基金概況】/拾、基金之資訊揭露/二、資訊揭露之方式、公告及取得方法/(二)	公告：所有事項均得以刊登於中華民國任一主要新聞報紙，或傳輸於證券交易所公開資訊觀測站、同業公會網站，或其他依金管會所指定之方式公告。經理公司就各子基金相關資訊之公告方式如下： **※經理公司就基金相關資訊所選定之公告方式** 投資人可至下表所列各平台查詢基金相關資訊之公告。受益人亦可親赴或電洽經理公司詢問。 經理公司網站：http://www.ctbcinvestments.com 投信投顧公會網站：https://www.sitca.org.tw	公告：所有事項均得以刊登於中華民國任一主要新聞報紙，或傳輸於證券交易所公開資訊觀測站、同業公會網站，或其他依金管會所指定之方式公告。經理公司就各子基金相關資訊之公告方式如下： **※經理公司就基金相關資訊所選定之公告方式** 投資人可至下表所列各平台查詢基金相關資訊之公告。受益人亦可親赴或電洽經理公司詢問。 經理公司網站：http://www.ctbcinvestments.com 投信投顧公會網站：https://www.sitca.org.tw	配合各子基金信託契約第 32 條第 1 項第 8 款及第 32 條第 2 項第 10 款內容增訂公告方式。

<table>
<tr>
<td></td>
<td>公開資訊觀測站：
https://mops.twse.com.tw

(表格內容之異動處如下)
<table>
<tr><th></th><th>經理公司網站</th><th>投信投顧公會網站</th><th>公開資訊觀測站</th></tr>
<tr><td>標的指數發生重大事項，對受益人有重大影響者。</td><td>V</td><td>V</td><td>V</td></tr>
<tr><td>其他重大應公告事項(如基金所持有之有價證券或證券相關商品，長期發生無法交割、移轉、平倉或取回保證金情事；基金所投資標的指數成分證券檔數或期貨交易部位曝險比率與所追蹤標的指數編製成分證券檔數或曝險比率有重大差異者；基金所投資標的指數成分證券及期貨交易部位之調整，導致基金績效與標的指數表現之追蹤差距(Tracking Difference)有重大差異者)</td><td>V</td><td>V</td><td></td></tr>
</table>
</td>
<td>公開資訊觀測站：
https://mops.twse.com.tw

(表格內容之異動處如下)
<table>
<tr><th></th><th>經理公司網站</th><th>投信投顧公會網站</th><th>公開資訊觀測站</th></tr>
<tr><td>其他重大應公告事項(如基金所持有之有價證券或證券相關商品，長期發生無法交割、移轉、平倉或取回保證金情事)</td><td>V</td><td>V</td><td></td></tr>
</table>
</td>
<td></td>
</tr>
</table>

「中國信託中國外資自由投資 50 不含 A 及 B 股傘型 ETF 證券投資信託基金之中國信託 MSCI 中國外資自由投資 50 不含 A 及 B 股 ETF 證券投資信託基金」

簡式公開說明書修訂對照表

條款項次	修正後	修正前	說明
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有價證券。追蹤 MSCI 中國外資自由投資 50 不含 A 及 B 股指數之績效表現為本基金投資組合管理之目標。原則上，本基金自上市日起，投資於標的指數成分股票總金額不得低於本基金淨資產價值之百分之七十(含)，但	本基金投資於中華民國及外國有價證券。追蹤 MSCI 中國外資自由投資 50 不含 A 及 B 股指數之績效表現為本基金投資組合管理之目標。原則上，本基金自上市日起，投資於標的指數成分股票總金額不得低於本基金淨資產價值之百分之七十(含)，但	新增標的指數簡介。

	為符合本基金之貼近指數操作與資金調度需要，經理公司得運用本基金從事證券相關商品之交易，以使本基金投資之指數成分股加計證券相關商品之整體曝險，能貼近本基金淨資產價值之百分之一百。 「MSCI 中國外資自由投資 50 不含 A 及 B 股指數」簡介：係由 MSCI 指數公司所編製的指數。以 MSCI China Free Index 為母指數，取其在香港掛牌(H 股)和美國掛牌(N 股)，且營收和資產超過 50%以上來自中國的企業並符合市值與流動性條件之前 50 大自由流通市值之成分股，以市值加權法，加入外資納入因子(FIF,Foreign Inclusion Factor)與價格調整因子(考慮除權息、分割合併等因素) 計算個股權重編製而成。	為符合本基金之貼近指數操作與資金調度需要，經理公司得運用本基金從事證券相關商品之交易，以使本基金投資之指數成分股加計證券相關商品之整體曝險，能貼近本基金淨資產價值之百分之一百。	

「中國信託中國外資自由投資 50 不含 A 及 B 股傘型 ETF 證券投資信託基金之中國信託 MSCI 中國外資自由投資 50 不含 A 及 B 股單日正向 2 倍 ETF 證券投資信託基金」證券投資簡式公開說明書修訂對照表

條款項次	修正後	修正前	說明
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之有價證券及符合主管機關許可之證券相關商品。追蹤 MSCI 中國外資自由投資 50 不含 A 及 B 股單日正向 2 倍指數之績效表現為本子基金投資組合管理之目標。原則上，本基金自上市日起，投資於與標的指數或相關之有價證券及證券相關商品交易之整體曝險，將能貼近本基金淨資產價值之百分之二百，惟不得低於本基金淨資產價值之百分之一百八十，且不得超過本基金淨資產價值之百分之二百二十。 「MSCI 中國外資自由投資 50 不	本基金投資於中華民國之有價證券及符合主管機關許可之證券相關商品。追蹤 MSCI 中國外資自由投資 50 不含 A 及 B 股單日正向 2 倍指數之績效表現為本子基金投資組合管理之目標。原則上，本基金自上市日起，投資於與標的指數或相關之有價證券及證券相關商品交易之整體曝險，將能貼近本基金淨資產價值之百分之二百，惟不得低於本基金淨資產價值之百分之一百八十，且不得超過本基金淨資產價值之百分之二百二十。	新增標的指數簡介。

	含A及B股單日正向2倍指數」 簡介：係由 MSCI 指數公司所編製的指數，並以 MSCI 中國外資自由投資50不含A及B股指數作為基礎，進行正向 2 倍槓桿之編製。「MSCI 中國外資自由投資 50 不含 A 及 B 股指數」則是以 MSCI China Free Index 為母指數，取其在香港掛牌(H 股)和美國掛牌(N 股)，且營收和資產超過 50%以上來自中國的企業並符合市值與流動性條件之前50大自由流通市值之成分股，以市值加權法，加入外資納入因子(FIF,Foreign Inclusion Factor)與價格調整因子(考慮除權息、分割合併等因素) 計算個股權重編製而成。		