



民國 110 年 2 月 19 日公告

聯博證券投資信託股份有限公司

「聯博收益傘型證券投資信託基金之聯博多元資產收益組合證券投資信託基金」及「聯博收益傘型證券投資信託基金之聯博債券收益組合證券投資信託基金」(此二基金得投資於非投資等級之高風險債券基金且配息來源可能為本金)

公告

聯博信字第 1100099 號

公告主旨：本公司所經理之「聯博收益傘型證券投資信託基金之聯博多元資產收益組合證券投資信託基金」(以下稱「聯博多元資產收益組合基金」)及「聯博收益傘型證券投資信託基金之聯博債券收益組合證券投資信託基金」(以下稱「聯博債券收益組合基金」)，因應法規修訂有關證券相關商品交易規定、短期票券之投資限制，同時修正聯博債券收益組合基金之投資策略及特色，爰配合修訂證券投資信託契約暨公開說明書相關內容，業經金融監督管理委員會(以下簡稱「金管會」)民國 110 年 2 月 17 日金管證投字第 1090379875 號函核准。



民國 110 年 2 月 19 日公告

公告依據：依證券投資信託基金管理辦法第 78 條暨本基金證券投資信託契約第 31 條規定辦理。

公告事項：

一、「聯博多元資產收益組合基金」及「聯博債券收益組合基金」為下列事項修正證券投資信託契約暨公開說明書相關內容，業經金管會民國 110 年 2 月 17 日金管證投字第 1090379875 號函核准，合先敘明。

(一) 依金管會 109 年 5 月 26 日金管證投字第 1090362109 號函放寬組合型基金為增加投資效率從事證券相關商品交易範圍，爰於「聯博多元資產收益組合基金」及「聯博債券收益組合基金」信託契約第 14 條第 5 項第 1 款增訂「為增加投資效率之目的，得運用本基金從事公債期貨、利率交換之證券相關商品交易」，另依證券投資信託基金管理辦法第 10 條第 1 項第 17 款修訂短期票券之投資限制，並自 110 年 4 月 22 日起生效。

(二) 又依金管會民國 106 年 6 月 29 日金管證投字第 1060023388 號函，於「聯博債券收益組合基金」信託契約第 14 條第 5 項第 2 款增訂「本基金得為增加投資效率之目的，承作信用違約交換指數(CDS Index，如 CDX 系列指數與 Itraxx 系列指數等) 交易」，並自 110 年 4 月 22 日起生效。



民國 110 年 2 月 19 日公告

(三) 末者，鑒於投資人對於投資等級債券型基金的需求日增，本公司爰修正「聯博債券收益組合基金」之長期投資定位，調整投資組合。茲修正聯博收益傘型基金公開說明書有關「聯博債券收益組合基金」之投資策略及特色等部分之文字，因應此部分之修訂，一併將「聯博債券收益組合基金」之風險報酬等級自 RR3 調整為 RR2，相關修正均自 110 年 4 月 22 日起生效。

二、聯博多元資產收益組合基金及聯博債券收益組合基金證券投資信託契約之修訂

對照表如後附，修訂後之公開說明書可於公開資訊觀測站

(<http://mops.twse.com.tw>)及本公司網站(<https://www.abfunds.com.tw/>)查詢。

三、特此公告。



民國 110 年 2 月 19 日公告

**聯博收益傘型證券投資信託基金之聯博多元資產收益組合證券投資信託基金
(本基金得投資於非投資等級之高風險債券基金且配息來源可能為本金)證券投資信託契約條文修訂對照表**

條次	修正後條文	條次	原條文	說明
第十四條	運用本基金投資證券及從事證券相關商品交易之基本方針及範圍	第十四條	運用本基金投資證券及從事證券相關商品交易之基本方針及範圍	
第五項第一款	經理公司得為避險之目的，運用本基金從事經金管會核定准予交易之證券相關商品，如衍生自股價指數、債券指數、債券或利率之期貨或選擇權或利率交換交易等證券相關商品；另為增加投資效率之目的，得運用本基金從事公債期貨、利率交換及衍生自指數之證券相關商品交易。前述證券相關商品之交易均應符合金管會「證券投資信託事業運用證券投資信託基金從事證券相關商品交易應行注意事項」及其他金管會之相關規定，如因有關法令或相關規定修正者，從其規定。	第五項第一款	經理公司得為避險之目的，運用本基金從事經金管會核定准予交易之證券相關商品，如衍生自股價指數、債券指數、債券或利率之期貨或選擇權或利率交換交易等證券相關商品；另為增加投資效率之目的，得運用本基金從事衍生自指數之證券相關商品交易。前述證券相關商品之交易應符合金管會「證券投資信託事業運用證券投資信託基金從事證券相關商品交易應行注意事項」及其他金管會之相關規定，如因有關法令或相關規定修正者，從其規定。	依 109 年 05 月 26 日金管證投字第 1090362109 號函，增訂本基金組合型基金從事證券相關商品交易規範，爰修訂之。
第五項第二款 第三目	與經理公司從事衍生自信用相關金融商品交易之交易對手，如該交易係於店頭市場且未經第三方結算機構方式為之者，除不得為經理公司之利害關係人外，並應符合下列任一信用評等機構評定之信用評等等級： 以下(略)	第五項第二款 第三目	與經理公司從事衍生自信用相關金融商品交易之交易對手，如該交易係於店頭市場且未經第三方結算機構方式為之者，除不得為經理公司之利害關係人外，並應符合下列任一信用評等機構評定之長期發行人信用評等等級： 以下(略)	配合實務作業，爰刪除之。
第八項 第六款	投資於任一公司發行、保證或背書之短期票券及有價證券總金額，不得超過本基金淨資產價值之百分之十，但投資於基金受益憑證者，不在此限；	第八項 第六款	投資於任一公司發行、保證或背書之短期票券總金額，不得超過本基金淨資產價值之百分之十，並不得超過新臺幣五億元；	依證券投資信託基金管理辦法第 10 條第 1 項第 17 款修訂。



民國 110 年 2 月 19 日公告

**聯博收益傘型證券投資信託基金之聯博債券收益組合證券投資信託基金(本基金得投資於非投資等級之高風險債券基金且配息來源可能為本金)證券投資信託契約
條文修訂對照表**

條次	修正後條文	條次	原條文	說明
第一條	定義	第一條	定義	
第二十六款	證券相關商品：指經理公司為避險需要或增加投資效率，運用本基金從事經金管會核定准予交易之證券相關之期貨、選擇權或其他金融商品。	第二十六款	證券相關商品：指經理公司運用本基金從事經金管會核定准予交易之證券相關之期貨、選擇權或其他金融商品。	依 109 年 05 月 26 日金管證投字第 1090362109 號函，增訂組合型基金從事證券相關商品交易規範，爰增訂之。
第十四條	運用本基金投資證券及從事證券相關商品交易之基本方針及範圍	第十四條	運用本基金投資證券及從事證券相關商品交易之基本方針及範圍	
第五項	經理公司得運用基金資產從事證券相關商品交易，並應遵守下列規定： (一)經理公司得為避險之目的，運用本基金從事經金管會核定准予交易之證券相關商品，如衍生自債券指數、債券或利率之期貨或選擇權或利率交換交易等證券相關商品；另為增加投資效率之目的，得運用本基金從事公債期貨、利率交換及衍生自指數之證券相關商品交易。前述證券相關商品之交易均需符合金管會「證券投資信託事業運用證券投資信託基金從事證券相關商品交易應行注意事項」及其他金管會之相關規定，如因有關法令或相關規定修正者，從其規	第五項	經理公司得運用基金資產從事證券相關商品交易，並應遵守下列規定： (一)經理公司得為避險之目的，運用本基金從事經金管會核定准予交易之證券相關商品，如衍生自債券指數、債券或利率之期貨或選擇權或利率交換交易等證券相關商品，但需符合金管會「證券投資信託事業運用證券投資信託基金從事證券相關商品交易應行注意事項」及其他金管會之相關規定，如因有關法令或相關規定修正者，從其規定。 (二)經理公司僅得為避險操作目的，從事衍生自信用相關金融商品交易（即信用違約交換 CDS 及 CDX index 與	依 109 年 05 月 26 日金管證投字第 1090362109 號函，增訂本基金從事證券相關商品交易規範，另依 106 年 6 月 29 日金管證投字第 1060023388 號函，增訂本基金得為增加投資效率之目的，承作信用違約交換指數 (CDS



民國 110 年 2 月 19 日公告

條次	修正後條文	條次	原條文	說明
	<p>定。</p> <p>(二) 經理公司從事衍生自信用相關金融商品交易應遵守下列規定，惟如有關法令另有規定或修正者，從其規定：</p> <p>1. 本基金承作衍生自信用相關金融商品（即信用違約交換(CDS) 及信用違約交換指數(CDS index，如 CDX 系列指數與 Itraxx 系列指數等)交易)，得為避險之目的作為信用保護的買方。</p> <p>2. 本基金得為增加投資效率之目的，承作信用違約交換指數(CDS Index，如 CDX 系列指數與 Itraxx 系列指數等)交易。</p> <p>3. 與經理公司從事衍生自信用相關金融商品交易之交易對手，如該交易係於店頭市場且未經第三方結算機構方式為之者，除不得為經理公司之利害關係人外，並應符合下列任一信用評等機構評定之信用評等等級：</p> <p>(1) 經 Standard & Poor's Corporation 評定，長期債務信用評等達 BBB-級（含）以上，短期債務信用評等達 A-3 級（含）以上者；或</p> <p>(2) 經 Moody' s Investors Service 評定，長期債務信用評等達 Baa3 級（含）以上，短期債務</p>		<p>Itraxx Index)，並應遵守下列規定，惟如有關法令另有規定或修正者，從其規定：</p> <p>1. 本基金承作衍生自信用相關金融商品（即信用違約交換 CDS 及 CDX index 與 Itraxx Index) 僅得為信用保護的買方。</p> <p>2. 與經理公司從事衍生自信用相關金融商品交易之交易對手，如該交易係於店頭市場且未經第三方結算機構方式為之者，除不得為經理公司之利害關係人外，並應符合下列任一信用評等機構評定之長期發行人信用評等等級：</p> <p>(1) 經 Standard & Poor's Corporation 評定，長期債務信用評等達 BBB-級（含）以上，短期債務信用評等達 A-3 級（含）以上者；或</p> <p>(2) 經 Moody' s Investors Service 評定，長期債務信用評等達 Baa3 級（含）以上，短期債務信用評等達 P-3 級（含）以上者；或</p> <p>(3) 經 Fitch Ratings Ltd. 評定，長期債務信用評等達 BBB-級（含）以上，短期債務信用評等達 F3 級（含）以上者；或</p>	<p>Index，如 CDX 系列指數、Itraxx 系列指數等)交易。</p>



民國 110 年 2 月 19 日公告

條次	修正後條文	條次	原條文	說明
	<p>信用評等達 P-3 級（含）以上者；或</p> <p>(3)經 Fitch Ratings Ltd. 評定，長期債務信用評等達 BBB- 級（含）以上，短期債務信用評等達 F3 級（含）以上者；或</p> <p>(4)經中華信用評等股份有限公司評定，長期債務信用評等達 twBBB- 級（含）以上，短期債務信用評等達 twA-3 級（含）以上者；或</p> <p>(5)經澳洲商惠譽國際信用評等股份有限公司台灣分公司評定，長期債務信用評等達 BBB-（tw）級（含）以上，短期債務信用評等達 F3（tw）級（含）以上者。</p> <p>4.有關本基金承作衍生自信用相關金融商品交易之控管措施及投資釋例詳公開說明書。</p>		<p>(4)經中華信用評等股份有限公司評定，長期債務信用評等達 twBBB- 級（含）以上，短期債務信用評等達 twA-3 級（含）以上者；或</p> <p>(5)經澳洲商惠譽國際信用評等股份有限公司台灣分公司評定，長期債務信用評等達 BBB-（tw）級（含）以上，短期債務信用評等達 F3（tw）級（含）以上者。</p> <p>3.有關本基金承作衍生自信用相關金融商品交易之控管措施及投資釋例詳公開說明書。</p>	
<p>第八項 第六款</p>	<p>投資於任一公司發行、保證或背書之短期票券及有價證券總金額，不得超過本基金淨資產價值之百分之十，<u>但投資於基金受益憑證者，不在此限</u>；</p>	<p>第八項 第六款</p>	<p>投資於任一公司發行、保證或背書之短期票券總金額，不得超過本基金淨資產價值之百分之十，<u>並不得超過新臺幣五億元</u>；</p>	<p>依證券投資信託基金管理辦法第10條第1項第17款修訂。</p>