

路博邁證券投資信託股份有限公司 公告

中華民國 115 年 7 月 1 日

主 旨：本公司經理之「路博邁 ESG 優選平衡證券投資信託基金」(下稱「路博邁 ESG 優選平衡基金」或「消滅基金」)與「路博邁收益成長多重資產證券投資信託基金」(下稱「路博邁收益成長多重資產基金」或「存續基金」)合併事宜。

說 明：

一、本合併案業經金融監督管理委員會中華民國(下同)115 年 6 月 30 日金管證投字第 1150345590 號函核准辦理。

二、存續基金名稱：路博邁收益成長多重資產基金

三、存續基金經理人：吳吟蒞 女士

四、存續基金之投資策略：

(一) 多重資產配置策略：

本基金資產配置中，將多元配置於股票、債券及基金受益憑證/ETF，前述各類資產投資比重上限為百分之七十(70%)，依據中期投資觀點、資產的預期收益、預期報酬率、風險及相關性等評估投資策略，並依各時期總體經濟環境及市場投資趨勢彈性調整各類資產配置比重。其中，股票將以成熟國家市場為主要投資，債券部位將以新興市場債、非投資等級債券及其他各類債券為主要投資，且整體非投資等級債券部位比重不超過百分之三十(30%)。為提升債券標的之多元性，適度納入美國 Rule 144A規定之債券。投資時就發行人之流動性風險、信用風險及債券標的償債順位與價差情形等進行評估，並控管持有美國 Rule 144A規定之債券占整體投資組合之比重，使其與整體投資組合之風險承擔與收益目標一致。

(二) 賣出選擇權賣權(PutWrite)策略：

藉由承作股票指數或ETF選擇權，為投資組合創造權利金收入來源，達到增進整體投資組合收益的效果，同時增加股票市場曝險。從事賣出指數或ETF選擇權賣權交易，在面臨市場上漲時，基金可收取權利金；反之，當面臨市場下跌時，基金可透過收取權利金而減少價值減損的幅度。根據回

測結果，長期而言，此一策略之總報酬接近直接投資至股市之報酬，但波動度僅約股市的三分之二。

(三) 基金受益憑證/ETF 投資策略：

基於流動性、分散標的風險、降低交易成本、以及靈活執行或調整資產配置需求等因素考量之下，將彈性布局於基金受益憑證或ETF，但單一基金受益憑證或ETF將不超過本基金淨資產價值之百分之三十(30%)。

(四) 避險策略：

運用質化與量化模組，必要時，將透過從事於證券相關商品交易之方式，調整整體投資部位的淨曝險，以降低可能的下檔風險。

五、消滅基金名稱：路博邁 ESG 優選平衡基金

六、存續基金與消滅基金之差異比較：

	路博邁收益成長多重資產基金 (存續基金)	路博邁 ESG 優選平衡基金 (消滅基金)
成立日期	107/10/15	113/03/21
保管銀行	玉山商業銀行	華南商業銀行
投資標的	主要投資於全球股票及全球多元券種債券等多元資產組合	主要投資於符合具「永續相關概念」之有價證券
基金種類	多重資產型	平衡型
風險等級	RR3	RR3
基金規模*	31.1億元	2.6億元
經理費	T、N 類型：1.8% R 類型：1.0%	T、N 類型：1.8% I 類型：0.9%(目前未開立)
保管費	0.26%	0.26%

註：*截至 115 年 5 月 20 日

七、合併目的：

- (一) 路博邁 ESG 優選平衡基金主要投資於符合具「永續相關概念」之有價證券，聚焦其企業活動有助於實現長期永續發展及符合 ESG 概念的股債投資標的，藉由挑選符合 ESG 概念的股債彈性配置，獲得長期資本增長機會。而路博邁收益成長多重資產基金主要投資全球，並以透過多重資產配置策略與賣出選擇權賣權策略，以多元的股、債及基金等多元資產配置獲得資本增長與

收益的機會。相較於消滅基金，存續基金(路博邁收益成長多重資產基金)投資範圍相對多元，且其多重資產之動態靈活操作方法較能應對不同市場環境，相對得提供多元報酬來源之表現機會，透過基金合併以提高單一基金資產規模，使基金之相關費用(例如:標的交易相關費用)得以降低，以減輕受益人之負擔，進而提升基金經營效益，亦可使研究或管理資源得以更形集中於存續之路博邁收益成長多重資產基金，有效運用本公司資源及基金資產，提高資產管理效益，使資產能更有效且充份之運用。

(二)避免因基金規模過小，而發生受益人經常性申購或贖回交易導致管理資產大幅波動，進而使基金經理人無法做有效之資產配置及分散風險。

(三)避免因受益人之大量贖回、資產規模縮水，導致基金必須進行清算，進而造成證券交易市場之賣壓，連帶影響市場之穩定性。

八、合併預期效益：

(一)提升基金資產管理效率：透過基金合併，整合公司產品線，將基金資產集中管理，可降低基金各項交易成本及相關費用，有效提高基金資產管理效率，同時提升本公司經營管理之競爭力。

(二)提升基金操作之穩定性：基金合併後，基金規模增加，流動性亦相對增加，基金經理人較不易因受益人申購及贖回交易影響，而被迫調整投資組合。有利於提升基金操作之彈性及基金績效的穩定性。

(三)避免基金面臨清算之風險：維護受益人權益，擴大基金規模，避免因基金資產規模縮水而面臨清算，迫使受益人僅得依清算後之價值取回投資之情形。

九、合併基準日：115 年 8 月 17 日

十、消滅基金最後交易申請日(最後交易日)：

「路博邁 ESG 優選平衡基金」之受益人若無意於合併基準日轉換至「路博邁收益成長多重資產基金」，得於本公告日起至最後交易日 115 年 8 月 13 日下午 4 點 30 分前提出買回申請或轉申購本公司其他投信系列基金，並免收買回及/或轉申購費用。未於前述期間提出買回或轉申購本公司其他投信系列基金之受益人，則原持有「路博邁 ESG 優選平衡基金」受益權單位數於合併基準日(115 年 8 月 17 日)將依換發比率全數轉換為「路博邁收益成長多重資產基金」受益權單位數。

十一、消滅基金換發存續基金受益權單位數之計算公式：

受益人原持有消滅基金各類型受益權單位數 × 各類型受益權單位合併換發比率。

各類型受益權單位合併換發比率=(消滅基金各類型受益權單位合併基準日單位淨值 ÷ 存續基金各類型受益權單位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。)

十二、 本公司自 115 年 8 月 17 日起至 115 年 8 月 19 日止，辦理消滅基金資產全部移轉於存續基金。資產移轉期間將停止受理消滅基金之交易(包含申購、買回及轉申購)。

十三、 換發新受益憑證期間：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」及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。

十四、 有關前述基金合併，受益人如需「路博邁收益成長多重資產基金」公開說明書，可逕至公開資訊觀測站（網址：<https://mops.twse.com.tw>）或經理公司網站（網址：<https://www.nb.com/taiwan>）查詢。