

# 摩根全球發現基金與摩根全球 $\alpha$ 基金

## 合併事宜 公告

日期：中華民國 107 年 7 月 30 日

字號：摩信(107)發字第 624 號

主旨：本公司經理之「摩根全球發現證券投資信託基金」（以下簡稱全球發現基金或消滅基金）與「摩根全球 $\alpha$ 證券投資信託基金」（以下簡稱全球 $\alpha$ 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)107年7月25日金管證投字第1070327069號函核准辦理。
- 二、存續基金名稱：全球 $\alpha$ 基金
- 三、存續基金經理人：蓋欣聖 先生
- 四、存續基金之投資策略：

本基金採用摩根資產管理(J.P. Morgan Asset Management)最新研發的「動態計量模型」(Dynamic Model)，此模型之精神係透過「由下而上」的主動選股策略再輔以被動計量工程嚴格紀律執行，利用股價評比(Value Analysis)、成長率動能(Growth Analysis)、以及企業體質(Quality Analysis)等三項主要評選準則綜合評選找出市場具有投資潛力之標的，將其結果加以分析與檢查其資料準確性再進行投資組合之建置。同時也利用各公開市場投資機構所提供的個股即時獲利數據(即 Earnings Revisions)以及具有強勁價格動能(Price Momentum)之股票等因素納入「動態計量模型」以掌握即時的市場主流趨勢。簡言之，此模型最重要的精神即是透過主動管理智慧及計量模型的紀律控管，達成不只被動地追求與大盤表現同步( $\beta \doteq 1$ )，更要積極追求主動管理報酬 $\alpha$ 值(指超越大盤之風險調整後報酬)之目標。基金之績效評估參考指標為「MSCI 世界指數(MSCI World Index)」。

- 五、消滅基金名稱：全球發現基金

- 六、合併目的及預期效益：

(一) 合併目的：

全球發現基金與全球 $\alpha$ 基金皆屬於海外股票型基金，投資範圍、方針及投資策略皆相同，在考量操作成本、效率及受益人權益等因素下，期望透過兩檔基金之合併，使基金淨資產

價值達一定經濟規模，以降低作業成本，並提升基金操作效率與彈性，為全體受益人創造更佳的操作績效。

(二) 預期效益：

1. 提升基金資產管理效率：透過基金合併，整合公司相同性質之產品線，除有效提高基金資產管理效率，同時亦提升本公司經營管理之競爭力。
2. 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。有利於提升基金穩定性，進而提升產品競爭力。

七、 合併基準日：107 年 10 月 19 日（星期五）

八、 消滅基金最後交易申請日(最後交易日)：107 年 10 月 17 日（星期三）；

自 107 年 10 月 18 日起不再受理消滅基金之交易（包含申購、買回及轉申購）

九、 全球發現基金(消滅基金)換發全球  $\alpha$  基金(存續基金)受益權單位數之計算公式：

受益人持有全球發現基金(消滅基金)之受益憑證單位數  $\times$  合併換發比率。

合併換發比率 = (全球發現基金合併基準日淨資產價值  $\div$  全球發現基金合併基準日受益權單位數)  $\div$  全球  $\alpha$  基金合併基準日單位淨值。

十、 全球發現基金與全球  $\alpha$  基金之差異比較：

	全球發現基金 (消滅基金)	全球 $\alpha$ 基金 (存續基金)
成立日期	96.04.03	93.11.12
保管銀行	第一商業銀行股份有限公司	中國信託商業銀行股份有限公司
投資地區	全球	全球
產品特色	本基金以全球 2,000 多檔股票為投資標的，投資組合原則上維持在 65~85 檔，屬較積極的全球型基金。	本基金以全球 3,000 檔股票為投資標的，投資組合維持在 250-300 檔，在充份分散投資下，屬低度波動之基金。
收益分配	本基金之收益全部併入本基金之資產，不予分配。	本基金之收益全部併入本基金之資產，不予分配。
基金規模*	3.80 億	25.75 億

投資組合分析**	金融：18.1% 資訊科技：16.3% 工業：14.8% 消費品：14.3% 醫療保健：11.8% 能源：6.6% 原物料：6.0% 基本民生用品：5.5% 流動性資金：2.6% 公用事業：2.5% 電訊服務：1.6%	資訊科技：20.4% 金融：18.5% 消費品：12.2% 工業：11.6% 醫療保健：11.2% 能源：7.8% 原物料：6.4% 基本民生用品：4.6% 公用事業：2.9% 流動性資金：2.1% 其他：1.3% 房地產：1.0%
經理費	1.65%	<b>1.75%</b>
保管費	0.25%~0.28%	0.26%

註：\*截至 107.06.30 / \*\* 統計至 107.05.31

十一、「全球發現基金」之受益人若無意於合併基準日轉換至「全球 $\alpha$ 基金」，得於本公告日起至最後交易日 107 年 10 月 17 日下午 4 點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「全球發現基金」受益權單位數將依換發比率全數轉換為「全球 $\alpha$ 基金」受益權單位數。

十二、原定期(不)定額投資「全球發現基金」之受益人若無意轉扣款「全球 $\alpha$ 基金」，請於 107 年 9 月 30 日前向本公司提出終止扣款，未提出申請者，將於合併基準日後自動轉扣款「全球 $\alpha$ 基金」。

十三、原「扣款日自由選」投資「全球發現基金」之受益人若無意轉扣款「全球 $\alpha$ 基金」，請於 107 年 10 月 17 日前下午 4 點前隨時變更為終止扣款，未提出申請者，將於合併基準日後自動轉扣款「全球 $\alpha$ 基金」。

十四、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。

十五、有關前述基金合併，受益人如需「全球  $\alpha$  基金」公開說明書，可逕至公開資訊觀測站（網址：[http:// mops.twse.com.tw](http://mops.twse.com.tw)）或摩根資產管理官方網站（網址：[http:// www.jp-rich.com.tw](http://www.jp-rich.com.tw)）查詢。