

兆豐櫃買富櫃200報酬指數指數投資證券

簡式公開說明書

刊印日期：民國 109年12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)投資人申購本指數投資證券後之權利義務詳述在公開說明書，投資人如欲申購本指數投資證券，建議參閱公開說明書。

壹、基本資料			
指數證券名稱	兆豐櫃買富櫃200報酬指數 指數投資證券	發行證券商	兆豐證券股份有限公司
發行總額	新臺幣3億元	發行單位數	60,000,000單位
發行價格	新台幣5元	發行期間	109/12/18~112/12/18
發行日期	109/12/18	到期日	112/12/18 (到期日如為非營業日則順延至下一個營業日)
標的指數名稱	櫃買富櫃200報酬指數(簡稱： 富櫃200)	交易市場	財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心
到期償還方式	現金匯撥交付投資人	收益分配	無
強制贖回條件	有		
貳、標的指數說明			
<p>一、指數授權契約之重要內容：(詳細內容請參見公開說明書第2頁)</p> <p>授權契約名稱：授权使用財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心編製之指數發行金融商品契約。甲方：財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心，乙方：兆豐證券股份有限公司。</p> <p>(一) 授權</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 甲方茲此非專屬授權乙方使用契約中由甲方發布之指數及指數名稱為發行、推廣、行銷及交易「金融商品」有關之事務。 2. 甲方係依所擁有之指數著作權、資料庫權利暨其他智慧財產權所有權，給予前揭授權。 <p>(二) 指數投資證券之授權費</p> <p>自交易首日起之第一年免付指數授權費，第二年起以每季季末最後一日流通在外餘額按當季授權天數及資產淨值年費率計算。</p> <p>(三) 契約之期間</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 本契約自生效日109年3月27日起生效，至已無任何乙方發行之「金融商品」在外流通時屆滿之。 2. 乙方僅限於自生效日起12個月內，始得行使不限發行次數地使用「指數」發行單一或數個「金融商品」之權利。 <p>二、指數之編製及計算方法：(詳細內容請參見公開說明書第4頁)</p> <p>(一) 櫃買富櫃200指數計算公式</p> $\sum_{i=1}^n \frac{(p_i \times s_i \times f_i \times w_i)}{d} \times 5,000$ <p>其中</p> <p>i=成分股家數，其中 $n \leq 200$</p> <p>p=成分股最近期成交價格</p> <p>s=成分股發行股數</p> <p>f=公眾流通量係數</p> <p>w=權重調整因子</p> <p>d=指數基值</p> <p>櫃買富櫃 200 指數於櫃檯買賣交易時間內，每隔 5 秒以成分股最新成交價格計算及公布即時指數一次，並於每日收市後計算一次收市指數。」</p> <p>(二) 櫃買富櫃200報酬指數計算公式</p> <p>櫃買富櫃200報酬指數係將價格指數考量現金股利因素後加以調整，用以反映包含現金股利之報酬。遇成分股除息時，標的指數計算方式之除數(指數基值)調整方式如下：</p> $\text{新基值} = \text{舊基值} \times \frac{\text{異動後總市值} - \text{當期發放現金股利}}{\text{異動前總市值}}$			

異動後總市值=異動前總市值+各採樣股票異動市值之加總

三、標的指數符合發行處理準則第二條第三項之說明：(詳細內容請參見公開說明書第 8 頁)

(一) 標的指數成分股皆為櫃買中心上櫃之股票，不涉及新臺幣匯率指標。

(二) 指數編製者應具有編製指數之專業能力及經驗

櫃買中心具有編制指數專業能力及經驗，其代表性指數包括櫃買指數、富櫃五十指數、台灣公債指數、高殖利率指數、勞工就業88指數、薪酬指數、公司治理指數、臺灣上櫃企業社會責任指數，以及富櫃200指數等。

(三) 指數應對所界定之市場具有代表性

櫃買富櫃200報酬指數採取流通量加權方式篩選具有流動性且市值規模最大的200檔上櫃股票，並適度提高基期點數之設定，希冀建立有效追蹤整體上櫃市場走勢之指標，同時增進指數商品化之可能性，期能提供市場參與者投資我國中小型股票的最佳參考指標，該指數應對所界定之市場具有代表性。

(四) 指數成分應具備分散性及流通性

1. 分散性

櫃買富櫃 200 指數之成分股為 200 檔，符合「財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心認可指數投資證券之標的指數資格應行注意事項」第五條成分股需至少 10 檔之規定。

檢視 109 年第 3 季底回溯過去 8 季之指數成分股收盤價所計算之權重，權重最高者為 108 年 9 月 27 日的穩懋（權重達 7.26%），低於前述注意事項中規定權重最高者不得高於 30% 之規定，未來依編制規則，定期選取 200 檔成分股，並以市值及公眾流通量作調整計算權重，具備足夠之分散性。

2. 流通性

依據成分股選取原則之流動性檢驗，審核前 12 個月的期間中，有超過 4 個月的每個月股票交易量沒有達到依公眾流通量減項調整後股數的 3%，則該成分股將被刪除。

另本公司兆豐櫃買富櫃 200 報酬指數指數投資證券發行額度 3 億元，依 109 年 10 月 30 日之成分股權重，計算每 1 億元各成分股所需買入之成數量佔當日各成分股成交量之比重最高不超過 3%，顯示指數成分具備流通性。

(五) 指數資訊應充分揭露並易於取得

投資人可在櫃檯買賣中心網站查詢指數價格及相關資料外，亦可於及基本市況報導網站取得即時標的指數資訊相關資料。

(六) 無違反法令規定或不宜列為標的指數之情事。

櫃買富櫃 200 報酬指數未有違反法令規定或不宜列為標的指數之情事。

四、有關標的指數發生對投資人權益有重大影響情事之通知及公告方式：

發行人應於事實發生之日起算二日內向主管機關申報並於事實發生日或傳播媒體報導日之次一營業日交易時間開始前公告。另有關標的指數累積漲跌幅度、指數成分股等之相關資訊，應定期傳輸於櫃買中心、公開資訊觀測站，或其他依金管會所指定之方式公告。(詳細內容請參見公開說明書第 10 頁)

五、如為編製價格指數，須敘明成分證券配息時，指數投資證券之配息方式或指標價值之調整方式：

本指數投資證券之標的指數係為報酬指數，非為價格指數，故不進行收益分配。

參、估計指標價值與指標價值之計算方式

一、估計指標價值(盤中)及指標價值(盤後)之計算方法：(詳細內容請參見公開說明書第12頁)

1. 估計指標價值

$$\text{估計指標價值}_T = \text{指標價值}_{T-1} \times \text{指數因子}_T - \text{投資手續費}_T$$

$$\text{估計指數因子}_T = \frac{\text{即時標的指數值}_T}{\text{標的指數值}_{T-1}}$$

$$\text{投資手續費}_T = \text{指標價值}_{T-1} \times \text{指數因子}_T \times \text{距前一交易日之日曆日數} \times \frac{(\text{年投資手續費率})}{365}$$

2. 盤後指標價值

$$\text{盤後指標價值}_T = \text{指標價值}_{T-1} \times \text{盤後指數因子}_T - \text{投資手續費}_T$$

$$\text{盤後指數因子}_T = \frac{\text{標的指數值}_T}{\text{標的指數值}_{T-1}}$$

$$\text{投資手續費}_T = \text{指標價值}_{T-1} \times \text{指數因子}_T \times \text{距前一交易日之日曆日數} \times \frac{(\text{年投資手續費率})}{365}$$

註：盤中估計指標價值以即時傳輸之標的指數值計算(至少每 15 秒更新計算一次)，盤後指標價值則以收盤後之標的指數值計算。

註：非交易日期間之每日投資手續費將累計於計算次一交易日之指標價值時扣除。

二、估計指標價值及指標價值揭露方式(公告時間與方式)：

二、指數投資證券盤中預估之每單位指標價值，依至少每十五秒更新乙次之頻率，於基本市況報導網站申報(<https://mis.twse.com.tw/stock/index.jsp>)。

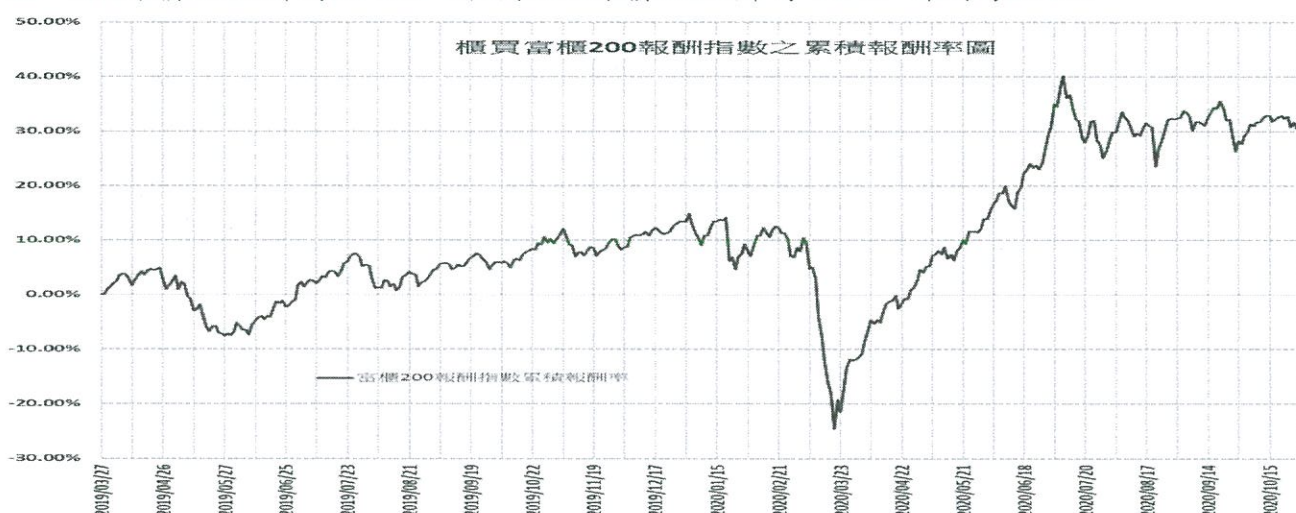
三、指數投資證券盤後每單位指標價值，於每一營業日公告於公開資訊觀測站(<https://mops.twse.com.tw/mops/web/index>)。

三、估計指標價值與交易價格差異原因：

本指數投資證券在於集中市場交易價格決於投資人買賣情形，可能不同於指標價值而產生折溢價情形，雖然指標價值反應標的指數漲跌，但指數投資證券實際交易價格受到諸多市場因素的影響，如標的指數成分股消息，國內政經情勢變化等因素，故使指數投資證券之指標價值與交易價格產生差異。

肆、標的指數績效

根據櫃買富櫃200報酬指數108年3月27日發布後，至109年10月30日之歷史資料所繪製之累積報酬率圖，期間累積之報酬率為28.86%，期間最低之累積之報酬率為-24.5%，最高為40.17%。



伍、投資人風險

投資人買賣 ETN，係為具有到期日之有價證券，追蹤標的指數表現，並在櫃檯買賣市場交易，交易 ETN 有可能會在短時間內產生極大利潤或極大的損失，於開戶、交易前應審慎考慮自身之財務能力及經濟狀況是否適合買賣此種商品。買賣 ETN 非為共同基金，並不實際持有指數成分資產，而係以 ETN 發行人之信用作為擔保，且 ETN 在存續期間不另支付息值。投資人應瞭解投資可能產生之潛在風險，知悉各項風險，詳細內容請參見公開說明書第 16 頁。

陸、投資人應負擔費用項目及其計算、收取方式

一、本指數投資證券之投資手續費於每交易日計算之指標價值中扣除，計算方式如下：

年投資手續費率為 0.5%

投資手續費=指標價值_{T-1}×(標的指數值_T/標的指數值_{T-1})×(年投資手續費率)/365

二、發行人於投資人申請賣回本指數投資證券時收取賣回手續費，計算方式如下：

賣回手續費=1%

賣回手續費=申請賣回單位數×指標價值×賣回手續費率

三、投資人應負擔租稅之項目均依財政部有關法令辦理

(一) 證券交易稅 0.1%。

(二) 證券交易所得稅：投資人於證券交易所得稅停徵期間，免納所得稅。

(詳細內容請參見公開說明書第 12 頁)

柒、證券商提前贖回、強制贖回及投資人申購賣回

- 一、提前贖回條件：本指數投資證券上櫃後滿一年，連續 20 個交易日流通在外單位數平均值低於已發行單位數之 10%，本公司得提前贖回流通在外之指數投資證券。(詳細內容請參見公開說明書第 21 頁)
- 二、強制贖回條件：本指數投資證券於存續期間，每日收盤後公布之指標價值低於發行價格之 20%時，本公司將強制贖回流通在外之指數投資證券。(詳細內容請參見公開說明書第 21 頁)
- 三、投資人申購賣回(詳細內容請參見公開說明書第 19 頁)
 - (一) 本指數投資證券不開放申購。
 - (二) 本指數投資證券自上櫃日至最後交易日，投資人得於任一營業日委託證券商以電腦申報方式辦理指數投資證券賣回作業，每一賣回基數最低為 50 萬個指數投資證券單位，每一賣回單位數應為賣回基數或其整倍數，賣回申請之截止時間為每營業日中午十二時，賣回款項於申請日之次日營業日，證券集中保管事業完成指數投資證券註銷作業後，由櫃買中心匯總款項後轉付證券商，由證券商交付投資人。
- 三、投資人賣回方式(詳細內容請參見公開說明書第 19 頁)
 - (一) 可賣回期限：上櫃日至到期前最後交易日。
 - (二) 賣回申請截止時間：申請日中午 12:00 委託證券商向發行人申請。

捌、公開說明書之取得

- 一、本指數證券之公開說明書備置於兆豐證券股份有限公司金融商品業務本部，投資人可免費索取。
- 二、投資人亦可於兆豐證券理財網 (<https://www.emega.com.tw/>) 及公開資訊觀測站 (<https://mops.twse.com.tw/mops/web/index>) 免費取得本公開說明書電子檔。

玖、其他

「『兆豐櫃買富櫃 200 報酬指數指數投資證券』」並非由證券櫃檯買賣中心(下稱「櫃買中心」)贊助、背書、銷售或推廣；且櫃買中心不就使用〔櫃買富櫃 200 報酬指數〕及／或該指數於任何特定日期、時間所代表數字之預期結果提供任何明示或默示之擔保或聲明。〔櫃買富櫃 200 報酬指數〕係由櫃買中心所編製及計算；櫃買中心不就〔櫃買富櫃 200 報酬指數〕之錯誤承擔任何過失或其他賠償責任；且櫃買中心無義務將指數中之任何錯誤告知任何人。」

本指數投資證券經金融監督管理委員會同意生效，惟不表示本指數投資證券絕無風險。本指數投資證券為無優先受償順位、無擔保之有價證券，且不保障本金、無第三方保證。發行指數投資證券之證券商僅承諾，在指數投資證券到期或提前贖回後支付投資人與所追蹤標的指數表現連結之報酬，另扣除投資手續費用或追蹤費用。本指數投資證券到期時或到期前賣回可領回金額，可能因市場波動、發行證券商違約或發生信用風險等因素，低於原始投資本金(最壞情形下可能為零)，投資人交易前應詳閱公開說明書並確定已充分了解本指數投資證券之風險及特色。證券商不得以其已取得標的指數資格認可及櫃檯買賣中心同意其擬發行之指數投資證券上櫃，作為證實其申請事項或保證指數投資證券價值之宣傳。本公開說明書之內容如有虛偽或隱匿之情事者，應由發行證券商及其負責人與其他曾在公開說明書上簽章者依法負責。查詢本公開說明書之網址，包括主管機關指定之資訊申報網站之網址及證券商揭露公開說明書相關資料之網址。

兆豐證券服務電話：(02)3322-7522