



## 00981T/平衡凱基雙核收息

### 凱基雙核收息債股平衡 ETF 基金證券投資信託基金

■ 凱基雙核收息債股平衡 ETF 證券投資信託基金(以下簡稱本 ETF)，依金管會民國 112 年 9 月 28 日金管證投字第 1120140025 號函辦理，發行 ETF 應加強資訊揭露事項：

一、本 ETF 標的指數為「臺灣指數公司 ICE 雙核債股平衡指數 (ICE TIP Dual-Core Balanced Multi-Asset Index)」為客製化指數。

二、本 ETF 指數編製規則：



來源：臺灣指數公司 & ICE Index：凱基投信整理

三、本 ETF 標的指數- 臺灣指數公司 ICE 雙核債股平衡指數，其與代表性指數-臺灣加權指數及 ICE BofA 美元公司債指數之相關風險特性差異及風險說明：

與代表性指數主要差異	差異說明	可能導致之風險
成分股篩選方式差異	本指數之成分股篩選，依據個別證券全市值篩選排名前 25 的證券，與代表性指數不同。	當符合篩選方式內的公司報酬與代表性指數內公司報酬出現差異時，本指數與代表性指數的報酬表現差異可能擴大。
成分股權重差異	本指數以自由流通市值加權為基礎，五月成分股調整時增加股利率增益調整權重，與代表性指數不同。	當個股權重與代表性指數個股權重差異擴大時，本指數與代表性指數的報酬表現差異可能擴大。
債券年期差異	本指數僅納入到期年限 10 年以上之債券，與代表性指數不同。	當不同年期債券報酬差異擴大時，本指數與代表性指數的報酬表現差異可



與代表性指數主要差異	差異說明	可能導致之風險
信用評級差異	本指數僅納入平均信評 BBB-至 BBB+ 之債券，與代表性指數不同。	能擴大。 當不同信評債券報酬差異擴大時，本指數與代表性指數的報酬表現差異可能擴大。
成分債篩選方式差異	本指數之成分債篩選，依據個別證券先依票息降序排列、後依到期日降序排列，並取排名前 100 名的證券，與代表性指數不同。	當符合篩選方式內的公司報酬與代表性指數內公司報酬出現差異時，本指數與代表性指數的報酬表現差異可能擴大。

資料來源：凱基投信整理

凱基證券投資信託股份有限公司 | 107年金管投信新字第003號 | 104台北市中山區明水路698號 | 服務專線：(02)2181-5678 | www.kgifund.com.tw

- 一、凱基投信獨立經營管理 | 本基金經金融監督管理委員會或其指定機構同意生效，惟不表示本基金絕無風險。基金經理公司以往之經理績效不保證本基金之最低投資收益；基金經理公司除盡善良管理人之注意義務外，不負責本基金之盈虧，亦不保證最低之收益，投資人申購前應詳閱基金公開說明書。
- 二、**本基金自成立日起至上市日前(不含當日)，經理公司不接受本基金受益權單位數之申購或買回。本基金受益憑證之上市買賣，應依證券交易市場有關規定辦理。**
- 三、**本基金自成立日起，即運用本基金資產進行投資組合佈局，本基金投資組合成分價格波動會影響本基金淨值表現。投資人於本基金成立日(不含當日)前參與申購所買入的本基金每受益權單位之發行價格，不等同於本基金掛牌上市之價格，參與申購投資人需自行承擔本基金自成立日起至掛牌日止期間之本基金淨資產價格波動所產生折/溢價之風險。本基金受益憑證上市後之買賣成交價格無升降幅度限制，並應依臺灣證券交易所(以下簡稱臺灣證交所)有關規定辦理。**
- 四、**本基金配息不代表基金實際報酬，且過去配息不代表未來配息；基金淨值可能因市場因素而上下波動。本基金配息可能由基金的收益平準金支付，任何涉及由收益平準金支出的部分，可能導致原始投資金額減損。本基金淨值組成項目，可於經理公司網站查詢。**
- 五、**本基金於上市日後將依臺灣證交所規定於臺灣證券交易時間內提供盤中估計淨值供投資人參考。本基金淨值以新臺幣計價而基金投資外幣計價之有價證券或期貨，匯率波動會影響本基金淨值之計算，而計算盤中估計淨值因評價時點及資訊來源不同，與實際基金淨值計算或有差異，投資人應注意盤中估計淨值與實際淨值可能有誤差值之風險，經理公司於臺灣證券交易時間內提供的盤中估計淨值僅供投資人參考，實際淨值應以本公司最終公告之每日淨值為準。**
- 六、**本基金投資無受存款保險、保險安定基金或其他相關保障機制之保障，投資人須自負盈虧。基金投資可能發生部分或全部本金之損失，投資人須自負盈虧。**
- 七、**指數免責聲明：「臺灣指數公司 ICE 雙核債股平衡指數」係由臺灣指數股份有限公司(臺灣指數公司)、ICE Data Indices, LLC(以上機構合稱「合作單位」)共同開發，並由臺灣指數公司單獨授權凱基證券投資信託股份有限公司使用。「合作單位」並未以任何方式贊助、背書、出售或促銷基金，且「合作單位」亦未明示或默示對使用指數之結果及/或指數於任一特定日期之任一特定時間或其他時間之數據提供任何保證或聲明。指數係由「合作單位」所計算。然「合作單位」就指數之任何錯誤、不正確、遺漏或指數資料之傳輸中斷對任何人均不負任何責任，且無任何義務將該等錯誤、不正確或遺漏通知任何人。(完整版警語請詳閱公開說明書)**