

富邦存股雙十等權重報酬指數指數投資證券

簡式公開說明書

刊印日期：108年4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	富邦存股雙十等權重報酬指數指數投資證券	發行證券商	富邦綜合證券股份有限公司
發行總額	新台幣(以下同)600,000,000元	發行單位數	120,000,000個單位
發行價格	每單位發行價格為5元	發行期間	中華民國108年4月17日至118年4月29日
發行日期	中華民國108年4月17日	到期日	中華民國118年4月29日，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	臺灣指數公司存股雙十等權重報酬指數	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

貳、標的指數說明

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2~3頁。

(一)指數授權範圍：臺灣指數公司授權發行人就與發行、推廣及銷售指數投資證券有關之事務，依本契約條款使用臺灣指數公司發布之指數及指數名稱之權利。

(二)授權費用及其他費用：包含固定費用及變動費用。

(三)契約之期間

1.生效日：107年11月1日。

2.本契約應自生效日起生效。除依本契約規定終止外，本契約於生效日起繼續有效。

3.除任一方於本契約有效期間屆滿之六個月前以書面通知他方不再續約外，本契約於效期屆滿時依相同條款自動續約一年，續約期滿時亦同。

二、指數之編製及計算方法：詳細內容請參見公開說明書第3~7頁。

(一)標的指數介紹：臺灣指數公司存股雙十等權重報酬指數，以臺灣證券交易所上市公司市值、流動性及股價等條件篩選，並以多因子評估指標排序，考量產業代表性篩選符合評估條件20檔股票，建構兼具市場代表性、股利與成長之股票組合，表彰符合長期投資價值成分股組合含現金股利報酬之投資績效。

(二)存股雙十等權重報酬指數由臺灣指數公司負責設計，委請臺灣證券交易所計算及即時資訊傳輸。

(三)臺灣指數公司依指數編製規則進行成分股定期審核。

(四)臺灣指數公司將保存所有成分股的收盤市值紀錄。

(五)指數計算方式：

$$\text{指數} = \frac{\text{指數成分股市值總和}}{\text{當日報酬指數之指數除數}} \times \text{基準指數}$$

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8~13頁。

(一)指數編製者應具有編製指數之專業能力及經驗：臺灣指數股份有限公司為臺灣證券交易所100%全資子公司，接受臺灣證券交易所委託辦理原有自行編製指數或與國外機構合作編製指數之維護、授權、行銷及其他相關業務，具備專業能力及豐富經驗。

(二)指數應對所界定之市場具有代表性：臺灣指數公司存股雙十等權重報酬指數以市值、流動性及股價等條件篩選，並以多因子評估指標排序，考量產業代表性篩選符合評估條件20檔股票，建構兼具市場代表性、股利與成長之股票組合，表彰符合長期投資價值成分股組合含現金股利報酬的投資績效。

(三)指數成分應具備分散性及流通性：指數每年定審成分股數目維持固定20檔，每檔成分股為等權重5%。依照108年1月30日之資料計算存股雙十等權重報酬指數成分股占指數之權重，權重最大之成分股為大立光，個股權重為5.61%，符合主管機關不得超過30%之規定，具備分散性。指數成分股須經流動性檢驗及自由流通市值篩選並經多因子評估指標計算及選股後，再依據上市股票傳產、電子、金融三大類別市值佔比進行類別成分股檔數配置，各類

別依多因子評估指標評分由大至小排列，選取 20 檔成分股建構投資組合，具備流動性。

(四)指數資訊應充分揭露並易於取得：

- 1.即時指數資訊透過臺灣證券交易所即時交易資訊傳輸提供給國內外資訊廠商，並由資訊廠商將指數資訊提供與國內外投資人。簽約資訊公司名冊登載於臺灣證券交易所網站 <http://www.twse.com.tw/zh/products/vendors>
- 2.於臺灣指數公司官網及證交所即時市況報導網站提供即時指數資訊，並於臺灣指數公司及臺灣證券交易所官網提供指數收盤資訊。網址分別如下：
臺灣證券交易所即時市況報導網站 <http://mis.twse.com.tw/stock/index.jsp>
臺灣指數公司網站 <https://www.taiwanindex.com.tw/>
臺灣證券交易所官網 http://www.twse.com.tw/zh/page/trading/exchange/MI_INDEX.html
- 3.指數之相關歷史數據及參考資料，可於臺灣指數公司官網下載供使用分析使用。網址 <https://www.taiwanindex.com.tw/index/history/IR0112>

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。

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：

本指數投資證券標的指數為報酬指數，非價格指數，不適用本項說明。

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：

估計指標價值(T)=(指標價值(T-1)*估計每日指數因子(T))-每日投資手續費(T)

估計每日指數因子(T)=估計標的指數值(T)/標的指數值(T-1)

盤後指標價值(T)=(指標價值(T-1)*盤後每日指數因子(T))-每日投資手續費(T)

盤後每日指數因子(T)=盤後標的指數值(T)/標的指數值(T-1)

二、估計指標價值揭露方式(公告時間與方式)

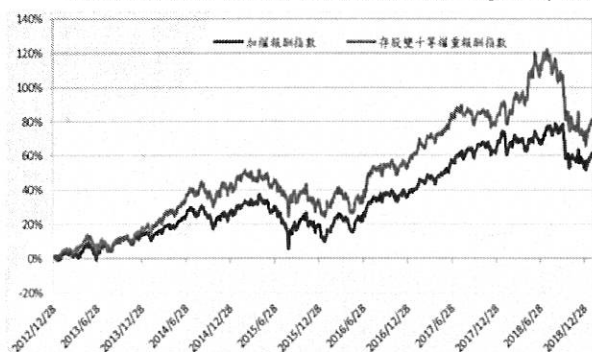
- 1.ETN 盤中預估之每單位指標價值，依至少每十五秒更新乙次之頻率，於臺灣證券交易所基本市況報導網站(<http://mis.twse.com.tw/stock/index.jsp>)申報。
- 2.ETN 盤後每單位指標價值，於每營業日開盤前申報可算得最近一營業日之資料，於公開資訊觀測站 (<http://mops.twse.com.tw>) 報導網站申報。

三、估計指標價值與交易價格差異原因：

- (一)發行人反應標的指數成分股買賣價差及交易成本。
- (二)指數投資證券盤中交易不熱絡導致前次成交時間與預估指標價值計算時點間隔過長。
- (三)投資人對股票市場信心強弱等因素導致次級市場交易價格高於或低於預估指標價值。
- (四)指數投資證券為處置股票
- (五)其他技術性問題

肆、標的指數績效

一、2012/12/28-2019/01/30指數歷史走勢圖



二、最近5年指數報酬率

	近 1 月	近 3 月	近 6 月	近 1 年	近 3 年	近 5 年
加權指數	4.60%	5.07%	-5.99%	0.03%	39.21%	45.21%
標的指數	3.09%	4.50%	-13.82%	0.10%	37.63%	53.70%

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，並在證券交易市場交易，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 ETN 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 16~18 頁。

陸、投資人應負擔費用項目及其計算、收取方式

詳細內容請參見公開說明書第 14 頁。

一、投資人年投資手續費率為 0.9%。

每日投資手續費(T)=指標價值(T-1)*每日指數因子(T)*年投資手續費率/365，反應於每日指標價值。

二、賣回手續費：申請賣回當日盤後公布指標價值之 0.9%，於賣回時支付。

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%

1.投資人轉讓 ETN 時，應由受讓人代徵證券交易稅。

2.投資人申請賣回，或發行人提前或屆期贖回本 ETN 時，賣回或贖回 ETN 註銷不再轉讓者，非屬有價證券之買賣，不課徵證券交易稅。

(二)證券交易所所得稅

投資人於證券交易所所得稅停徵期間，免納所得稅。

柒、證券商提前贖回、強制贖回及投資人申購賣回

詳細內容請參見公開說明書第 18~20 頁。

一、提前贖回、強制贖回之條件及程序

(一)提前贖回條件：發行半年後，指數投資證券流通在外單位數連續 20 個交易日均小於申報生效單位數之 5%，發行人得提前贖回。

(二)強制贖回條件：盤後公布之指標價值小於新台幣 1 元時，發行人將強制贖回。

(三)符合提前贖回或強制贖回條件之通知方式：發行人應於符合條件日之次一營業日，檢附終止上櫃時程及相關附件函報櫃檯買賣中心並公告。

(四)提前贖回或強制贖回價格：以符合提前贖回或強制贖回條件當日之次一營業日為最後交易日，以最後交易日盤後公布之指標價值計算償還金額。

二、投資人申購方式及其程序：本指數投資證券不開放投資人申購。

三、投資人賣回方式及其程序

(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 以前委託證券商向發行人申請。若有不接受賣回情事者，發行人應即時於網站及公開資訊觀測站公告，並於當日下午 15:00 前通知證券商轉知投資人。

(三)賣回價格：申請賣回當日盤後公布之指標價值。

(四)賣回手續費：申請賣回當日盤後公布指標價值之 0.9%。

(五)最低賣回數量：500,000 單位，投資人申請賣回之單位數應為最低賣回數量或其整倍數，如未達此基數，只能透過證券交易市場買賣。

(六)符合下列條件之一，且發行人避險部位達本 ETN 流通在外總值 90% 以上，發行人得不受理投資人賣回，待下列情況消失後開始（最快可自消失當日開始）接受投資人賣回：

1.申請日前一日指數權重合計達 20% 之成分股所屬市場於申請日休市，致申請日本 ETN 賣回總價金之避險部位無法完全出售。

2.申請日前一日指數權重合計達 20% 之成分股於申請日暫停交易或停止買賣，致申請日本 ETN 賣回總價金之避險部位無法完全出售。

3.申請日前一日指數權重合計達 20% 之成分股於申請日收盤價格跌停，致申請日本 ETN 賣回總價金之避險部位無法完全出售。

4.不可歸責於發行人之原因致通常使用之通信中斷、電腦系統異常、電力異常。

5.證券集中保管事業因故無法進行指數投資證券劃撥轉帳交付或註銷作業。

6.其他不可抗力之天然災害或重大事件，致申請日本 ETN 賣回總價金之避險部位無法完全出售或發行人就本 ETN 無法正常作業。

捌、公開說明書之取得

一、本指數證券之公開說明書備置於富邦綜合證券股份有限公司金融市場部，投資人可免費索取。

二、投資人亦可於富邦網站 (<https://warrants.fbs.com.tw/>) 及公開資訊觀測站 (<http://mops.twse.com.tw/>) 免費取得本公開說明書電子檔。

玖、其他

無

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。「富邦存股雙十等權重報酬指數指數投資證券」並非由臺灣指數股份有限公司贊助、認可、銷售或推廣；且臺灣指數股份有限公司不就使用「臺灣指數公司存股雙十等權重報酬指數」或該等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。「臺灣指數公司存股雙十等權重報酬指數」係由臺灣指數股份有限公司編製及計算；惟臺灣指數股份有限公司不就「臺灣指數公司存股雙十等權重報酬指數」之錯誤承擔任何過失或其他賠償責任；且臺灣指數股份有限公司無義務將該指數中之任何錯誤告知任何人。

富邦證券服務電話：(02)8771-6888